LEGG MASON
GLOBAL ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht (Ungeprüft)

Legg Mason Global Funds Plc

Ein Umbrellafonds mit getrennter Haftung der Teilfonds

Für die sechs Monate bis 31. August 2019

Das Angebot der Anteile der Teilfonds Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund, Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund, Legg Mason Brandywine Global Macro Fund, Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund, Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund, Legg Mason ClearBridge Global SRI Equity Fund, Legg Mason ClearBridge Growth Fund, Legg Mason Emerging Markets Select Equity Fund, Legg Mason Japan Equity Fund, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund, Legg Mason Martin Currie Australia Equity Income Fund, Legg Mason Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund, Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund, Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund, Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund, Legg Mason Martin Currie North American Fund, Legg Mason Multi-Asset Infrastructure Income Fund, Legg Mason Opportunity Fund, Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund, Legg Mason QS US Large Cap Fund, Legg Mason RARE Global Infrastructure Income Fund, Legg Mason US Equity Fund, Legg Mason Western Asset Asian Income Fund, Legg Mason Western Asset Global Credit Absolute Return 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 Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund, Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund wurde der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht nicht gemäß § 310 KAGB (Kaptalanlagegesetzbuch) gemeldet.

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Informationen 3

Brief an die Anteilsinhaber 13

Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund 14
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund 24
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund 41
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund 44
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund 47
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US High Yield Fund 52
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund 56
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund 59
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund 62
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund 64
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund 66
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund 69
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ 73
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global Credit Fund 78
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund 82
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ 84
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^ 94
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ 97
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ 107
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ 110
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ 117
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^ 123
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund 129
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ 132
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^ 134
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund^ 136
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^ 139
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ 141
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ 143
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ 145
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ 147
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ 149
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Value Fund 151
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^ 152
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund 153
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund 154
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund 155
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund 157
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ 158
Anlagenportfolio – Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund 159
Anlagenportfolio – Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund 162
Anlagenportfolio – Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund 164
Anlagenportfolio – Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund 165
Anlagenportfolio – Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund 167
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^ 169
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ 171
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ 172
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^ 173
Anlagenportfolio – Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^ 175
Anlagenportfolio – Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^ 176

Bilanz – Legg Mason Global Funds Plc 178
Gesamtergebnisrechnung – Legg Mason Global Funds Plc 198
Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist – Legg Mason Global Funds Plc 208

Erläuterungen zum Abschluss – Legg Mason Global Funds Plc 235

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) – Legg Mason Global Funds Plc 256

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Inhaltsverzeichnis – *(Fortsetzung)*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund 263
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund 263
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund 264
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund 264
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund 265
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US High Yield Fund 265
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund 266
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund 266
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund 267
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund 267
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund 268
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund 268
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ 268
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^ 269
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund 269
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ 269
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^ 270
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ 270
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ 270
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ 271
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ 271
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^ 272
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund 272
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ 272
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^ 273
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund^ 273
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^ 273
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ 274
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ 274
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ 274
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ 275
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ 275
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Value Fund 276
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^ 276
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund 277
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund 277
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund 278
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund 278
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ 279
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund 279
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund 280
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund 280
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund 280
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund 281
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^ 281
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ 281
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^ 281
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^ 282
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ 282
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^ 282
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^ 283
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^ 283

Anhang: EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften („SFT-Verordnung“) 284

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Allgemeine Informationen

Verwaltungsrat

Joseph Carrier (USA)
Brian Collins (Irland) (unabhängig)
Fionnuala Doris (Irland) (unabhängig)
Joseph Keane (Irland) (unabhängig)
Joseph LaRocque (USA)
Jane Trust (USA)
Jaspal Sagger (Großbritannien) *
Victoria Rock (Großbritannien) *
* trat am 21. Juni 2019 als unabhängiges Verwaltungsratsmitglied zurück.
** ernannt am 19. September 2019.

Geschäftssitz

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

Secretary

Bradwell Limited
Ten Earlsfort Terrace
Dublin 2, Irland

Hauptvertriebs- und Hauptinformationsstelle

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

Weitere Vertriebs- und Informationsstellen

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

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

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

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

Berichtsfondsstatus und Ausschüttungsfondsstatus (nur für britische Anteilsinhaber)

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

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

Vertreter in der Schweiz

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

Zahlstelle in der Schweiz

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

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

Irischer Rechtsberater

Arthur Cox
Ten Earlsfort Terrace
Dublin 2, Irland

Verwahrstelle

BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited
One Dockland Central
Guild Street, IFSC
Dublin 1, Irland

Unabhängige Wirtschaftsprüfer

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

Verwaltungsstelle

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

Verwalter und Promoter[^]

Legg Mason Investments (Ireland) Limited
6. Etage, Gebäude 3
Number One Ballsbridge
126 Pembroke Road
Dublin 4, Irland
[^] Ernannt am 22. März 2019

Promoter

Legg Mason Investments (Europe) Limited[†]
201 Bishopsgate,
London EC2M 3AB
Vereinigtes Königreich
[†] Bis zum 22. März 2019

Allgemeine Informationen – *(Fortsetzung)*

Fondsbezeichnung	Fondsauflegungsdatum	Anlagemanager/Unteranlageverwalter[β]
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund*	30. August 2002	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund*	20. April 2007	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund*	1. Oktober 2003	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund*	24. Februar 2004	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund*	29. August 2002	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund*	27. Februar 2004	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund*	24. Februar 2004	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA

Allgemeine Informationen – *(Fortsetzung)*

Fondsbezeichnung	Fondsauflegungsdatum	Anlagemanager/Unteranlageverwalter[β]
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund*	21. Oktober 2011	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145 Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasilien
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund*	20. April 2007	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund*	20. April 2007	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund*	12. Juni 2008	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **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	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA

Allgemeine Informationen – *(Fortsetzung)*

Fondsbezeichnung	Fondsauflegungsdatum	Anlagemanager/Unteranlageverwalter[β]
		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
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^*	3. Dezember 2010	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^*	19. November 2010	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **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 Euro High Yield Fund*	3. Dezember 2010	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^*	5. September 2013	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA

Allgemeine Informationen – *(Fortsetzung)*

Fondsbezeichnung	Fondsauflegungsdatum	Anlagemanager/Unteranlageverwalter β
		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
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^*	16. Dezember 2015	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^*	16. Dezember 2015	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasilien Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145 Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^*	31. Dezember 2015	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA

Allgemeine Informationen – *(Fortsetzung)*

Fondsbezeichnung	Fondsauflegungsdatum	Anlagemanager/Unteranlageverwalter[β]
		Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145 Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan Western Asset Management Company Pty Limited Stufe 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasilien
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^*	13. Januar 2016	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^*	13. Januar 2016	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^*	17. November 2016	**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Asian Income Fund*†		**Anlagemanager:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich **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 Brandywine Global Fixed Income Fund*	1. Oktober 2003	**Anlagemanager:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^*	3. April 2012	**Anlagemanager:** Brandywine Global Investment Management, LLC

Allgemeine Informationen – *(Fortsetzung)*

Fondsbezeichnung	Fondsauflegungsdatum	Anlagemanager/Unteranlageverwalter[β]
		1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^*	30. November 2012	**Anlagemanager:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund^*	25. Juni 2010	**Anlagemanager:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^*	10. Mai 2012	**Anlagemanager:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^*	3. Juni 2013	**Anlagemanager:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^*	30. Juni 2014	**Anlagemanager:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^**	31. Dezember 2015	**Anlagemanager:** 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	**Anlagemanager:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund*^	30. Oktober 2017	**Anlagemanager:** 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	**Anlagemanager:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global – EM Macro Bond Fund*†^		**Anlagemanager:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason ClearBridge Value Fund**	23. März 1998	**Anlagemanager:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^***	1. September 2006	**Anlagemanager:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor

Allgemeine Informationen – *(Fortsetzung)*

Fondsbezeichnung	Fondsauflegungsdatum	Anlagemanager/Unteranlageverwalter[β]
		New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund**	20. April 2007	**Anlagemanager:** 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	**Anlagemanager:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund**	20. April 2007	**Anlagemanager:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund**	3. Juni 2013	**Anlagemanager:** 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	**Anlagemanager:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund**	8. November 2002	**Anlagemanager:** Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund**	1. März 2004	**Anlagemanager:** Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund**	30. August 2002	**Anlagemanager:** QS Investors, LLC 880 Third Avenue, 7th Floor New York, NY 10022 USA
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund**	25. Februar 2004	**Anlagemanager:** QS Investors, LLC 880 Third Avenue, 7th Floor New York, NY 10022 USA
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund**	29. Dezember 2010	**Anlagemanager:** QS Investors, LLC 880 Third Avenue, 7th Floor New York, NY 10022 USA
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^~**	11. März 2016	**Anlagemanager:** Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland **Unteranlageverwalter:** Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited 1 George Street, #23-02 Singapur 049145
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^~**	11. März 2016	**Anlagemanager:** Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland

Allgemeine Informationen – *(Fortsetzung)*

Fondsbezeichnung	Fondsauflegungsdatum	Anlagemanager/Unteranlageverwalter[β]
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^[þ]**	11. März 2016 (hat den Handel am 5. Oktober 2017 eingestellt)	**Anlagemanager:** Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^~**	24. November 2017	**Anlagemanager:** Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Scotland
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^~**	9. November 2018	**Anlagemanager:** Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^**	9. Dezember 2016	**Anlagemanager:** RARE Infrastructure International Pty Limited (Tochtergesellschaft von RARE Infrastructure Limited) Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^**	31. März 2017	**Anlagemanager:** RARE Infrastructure International Pty Limited (Tochtergesellschaft von RARE Infrastructure Limited) Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien

Allgemeine Informationen – *(Fortsetzung)*

Fondsbezeichnung	Fondsauflegungsdatum
Legg Mason PCM US Equity Fund^þ	8. Januar 2008 (Handel eingestellt am 24. August 2010, neu aufgelegt am 13. April 2012 und Handel wieder eingestellt am 30. August 2013)
Legg Mason Congruix Japan Equity Fund^þ	2. Oktober 2008 (Handel eingestellt am 30. November 2010)

† *Am 31. August 2019 hatten diese Fonds den Handel noch nicht aufgenommen.*
^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*
~ *Der Bewertungszeitpunkt ist 12:00 Uhr in London an jedem Handelstag*
µ *Money Market Fund.*
* *Rentenfonds (Fonds, die überwiegend in Rentenwerte und verzinsliche Wertpapiere investieren).*
** *Aktienfonds (Fonds, die überwiegend in Aktien investieren).*
*** *Multi-Asset-Fonds (jeder Fonds, der in der entsprechenden* Beilage *des Prospekts als „Multi-Asset-Fonds" definiert ist).*
β *Überarbeitete Aufstellung der Anlageverwalter und Unteranlageverwalter für jeden Fonds gemäß aktualisiertem Prospekt vom 22. März 2019.*
þ *Ausstehende Aufhebung der Genehmigung durch die Zentralbank.*

Weitere Informationen

Für weitere Informationen über das Fonds-Angebot (die „Fonds") von Legg Mason Global Funds Plc wenden Sie sich bitte an folgende Stellen:

Für professionelle Anleger in Europa (ohne Großbritannien und Schweiz)

Legg Mason Investments (Ireland) Limited
6. Etage, Gebäude 3
Number One Ballsbridge
126 Pembroke Road
Dublin 4, Irland

www.leggmasonglobal.com

Für zugelassene Makler in Nord-, Süd- und Mittelamerika

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

www.leggmasonamericas.com

Auf den jeweiligen Internetseiten finden Sie Informationen über:

- Tägliche Quotierungen
- Literatur, einschließlich Datenblätter sowie die neuesten Informationen über die einzelnen Fonds
- Zusätzliche Informationen über Legg Masons Vermögensverwaltungsunternehmen, die die Fonds verwalten

Brief an die Anteilsinhaber

Sehr geehrte Anteilsinhaberin, sehr geehrter Anteilsinhaber,

Wir freuen uns, Ihnen den Halbjahresbericht für Legg Mason Global Funds Plc (die „Gesellschaft") für den am 31. August 2019 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 globale wirtschaftliche Expansion setzte sich in den sechs Monaten bis zum 31. August 2019 fort, obwohl es Gegenwind durch globale Handelskonflikte gab. In seinem *World Economic Outlook Update,* vom Juli 2019 sagte der Internationale Währungsfonds („IWF")[i], dass das globale Wachstum weiterhin gedämpft ist. Seit dem Bericht über den Weltwirtschaftsausblick im April haben die Vereinigten Staaten die Zölle für bestimmte chinesische Importe weiter erhöht, wobei China durch die Erhöhung der Zölle für einen Teil der US-Importe Vergeltung ausübte. Globale Technologielieferketten waren von der Aussicht auf US-Sanktionen bedroht, die Brexit-bedingte Unsicherheit hielt an und steigende geopolitische Spannungen trübten die Energiepreise. Vor diesem Hintergrund wird für 2019 ein globales Wachstum von 3,2 Prozent prognostiziert, das 2020 bis zu 3,5 Prozent einsteigen wird. Die Risiken für die Prognose sind vor allem auf den Nachteil gerichtet. Dazu gehören weitere Handels- und Technologiespannungen, die die Stimmung und die langsamen Investitionen schüren; ein langwieriger Anstieg der Risikoscheue, der die finanziellen Schwachstellen, die sich nach Jahren niedriger Zinssätze weiter ansammeln, gefährdet; dazu kommt schließlich auch der zunehmende Disinflationsdruck, der die Schwierigkeiten im Schuldendienst erhöht, den Raum der Geldpolitik einengt, um Abschwünge zu kontern und nachteilige Schocks hartnäckiger als normal zu machen." Auf regionaler Ebene prognostiziert der IWF ein US-Wirtschaftswachstum 2019 von 2,6 %, verglichen mit 2,9 % im Jahr 2018. Für die Eurozone wird ein Wachstum von 1,3 % im Jahr 2019 erwartet, gegenüber 1,9 % im Jahr 2018. Für Japans Wirtschaft wird für 2019 eine Wachstumsrate von 0,9 % vorhergesagt, während im Vorjahr 0,8 % erzielt wurden. Der IWF prognostiziert, dass sich das allgemeine Wachstum in den[ii] 2019 auf 4,1 % beschleunigen wird, gegenüber 4,5 % im Jahr 2018.

Marktüberblick – Rentenmärkte[iii]

Die globalen Rentenmärkte generierten während des Berichtszeitraums gemischte Ergebnisse. Sowohl die kurz- als auch die langfristigen Renditen der US-Schatzanleihen[iv] gingen in den sechs Monaten bis zum 31. August 2019 zurück. Die Rendite des zweijährigen Finanzministeriums begann den Berichtszeitraum mit 2,52 % und lag am Ende des Zeitraums bei 1,50 %. Die Rendite der zehnjährigen US-Schatzanleihen lag zu Beginn des Berichtszeitraums bei 2,73 % und am Ende des Zeitraums bei 1,50 % (Anleihenrenditen und Preise bewegen sich in die entgegengesetzte Richtung). Der Federal Reserve Board (die „Fed")[v] hat 2018 den Federal Funds Rate[vi] viermal angehoben und das Jahr in einem Bereich zwischen 2,25 % und 2,50 % beendet. Im Januar 2019 kündigte die Fed jedoch die Annahme eines datenabhängigen Ansatzes an und signalisierte eine Pause bei der Erhöhung des Leitzinses. Schließlich senkte die Fed die Zinssätze bei ihrer Sitzung im Juli 2019 auf einen Bereich zwischen 2,00 % und 2,25 %. Dies stellte den ersten Schnitt seit 2008 dar. Die Renditen längerfristiger Staatsanleihen bewegten sich in Europa im Berichtszeitraum allgemein nach unten. Andernorts verzeichneten Investment-Grade[vii]-Unternehmensanleihen[viii] und unterbewertete Unternehmensanleihen solide Renditen, ebenso wie US-Dollar-denominierte Staatsanleihen aus Schwellenländern.

Marktüberblick – globale Aktien[ix]

Globale Aktien generierten im Berichtszeitraum gemischte Renditen. Trotz der Bedenken wegen Handelskonflikten erzielten US-Aktien solide Ergebnisse. Obwohl es mehrere Rückschläge gab, wurden diese durch Kräfteperioden mehr als ausgeglichen. Unterstützung erhielt der Markt manchmal von der Hoffnung auf Fortschritte bei den Handelsverhandlungen zwischen den USA und China sowie durch die Erwartungen bezüglich mehrerer Leitzinsanhebungen der Fed in der zweiten Jahreshälfte 2019. Anderswo waren die entwickelten Nicht-US-Aktien im gesamten Zeitraum relativ flach. Neben den Handelsbedenken waren sie von Anzeichen für ein moderates Wachstum und einer Reihe geopolitischer Probleme, darunter der Brexit, negativ betroffen. Schließlich erzielten die Aktien der Schwellenmärkte schlechte Ergebnisse. Dies war teilweise auf das verlangsamte globale Wachstum und eine Stärkung des US-Dollars zurückzuführen.

Der Wert von Anlagen und deren Erträge können sowohl steigen als auch fallen, und Anleger erhalten das von ihnen ursprünglich investierte Kapital möglicherweise nicht zurück. Die frühere Wertentwicklung ist kein zuverlässiger Indikator für 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 2019, sofern nichts anderes angegeben ist.

Legg Mason Global Funds plc („LMGF plc") ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital, die als Unternehmen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW") organisiert ist. LMGF plc wird in Irland von der irischen Zentralbank zugelassen.

Die Informationen wurden aus Quellen erstellt, die als zuverlässig erachtet wurden. Die Informationen werden in keiner Weise von einem Unternehmen oder einer Tochtergesellschaft von Legg Mason, Inc. (Zusammen „Legg Mason") garantiert.

Einzelne Wertpapiere sind nur Beispiele und stellen keine Empfehlungen zum Kauf oder Verkauf einer Investition dar.

Die geäußerten Meinungen können sich ohne Vorankündigung ändern und berücksichtigen nicht die Bedürfnisse von Anlegern.

Bevor Sie eine Anlage tätigen, sollten Sie das Antragsformular-Prospekt und KIID lesen. Diese Dokumente können kostenlos in Englisch, Französisch, Deutsch, Italienisch und Spanisch von der LMGF plc-Niederlassung in Riverside Two, Sir John Rogerson's Quay, Grand Canal Dock, Dublin 2, Irland, vom LMGF PLC-Administrator, BNY Mellon Fund Services (Irland) Designated Activity Company oder von www.leggmasonglobal.com bezogen werden.

In Europa (außer Großbritannien und der Schweiz) wird diese Werbung für Finanzprodukte von Legg Mason Investments (Irland) Limited, Sitz im 6. Stock, Gebäude Drei, Number One Ballsbridge, 126 Pembroke Road, Ballsbridge, Dublin 4, D04 EP27, Irland, herausgegeben. Eingetragen in Irland unter der Firmennummer 271887. Zugelassen und beaufsichtigt durch die irische Zentralbank.

In Großbritannien wird diese Werbung für Finanzprodukte von Legg Mason Investments (Europe) Limited, Sitz 201 Bishopsgate, London, EC2M 3AB, durchgeführt. Eingetragen in England und Wales unter der Firmennummer 1732037. Zugelassen und beaufsichtigt durch die Financial Conduct Authority.

In der Schweiz wird diese Werbung für Finanzprodukte von der Legg Mason Investments (Schweiz) GmbH, die von der Schweizer Finanzmarktaufsicht FINMA zugelassen wurde, durchgeführt.

Anleger in der Schweiz: Der Vertreter in der Schweiz ist FIRST INDEPENDENT FUND SERVICES LTD., Klausstraße 33, 8008 Zürich, Schweiz und die Zahlstelle in der Schweiz ist die NPB Neue Privat Bank AG, Limmatquai 1, 8024 Zürich, Schweiz. Kopien der Statuten, des Prospekts, der wesentlichen Anlegerinformationen sowie der Jahres- und Halbjahresberichte der Gesellschaft können kostenlos beim Schweizer Vertreter angefordert werden.

Wir danken Ihnen für Ihr anhaltendes Vertrauen.

Mit freundlichen Grüßen

Legg Mason Investments (Ireland) Limited

September 2019

[i] Der Internationale Währungsfonds („IWF") ist eine aus 189 Ländern bestehende Organisation zur Förderung der globalen geldpolitischen Kooperation, zur Sicherung der Finanzmarktstabilität, zur Erleichterung des internationalen Handels, zur Förderung von hoher Beschäftigung und nachhaltigem Wirtschaftswachstum sowie zur Reduzierung von Armut auf der Welt.

[ii] Schwellenmärkte – Im Hinblick auf Anlagen sind Schwellenmärkte Länder, deren Finanzmärkte weniger entwickelt sind und in denen der Anlegerschutz und die Marktinfrastruktur häufig schwächer sind als in entwickelten Märkten wie dem Vereinigten Königreich.

[iii] Rentenwerte – Anleihen.

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

[v] US Federal Reserve – die Zentralbank der Vereinigten Staaten und das mächtigste Finanzinstitut auf der Welt.

[vi] Der Federal Funds Rate ist der Satz, den ein Depotinstitut bei einem Nachtverkauf sofort verfügbarer Fonds (Guthaben bei der Federal Reserve) an ein anderes Depotinstitut berechnet; Der Tarif kann von Depotinstitut zu Depotinstitut und von Tag zu Tag variieren.

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

[viii] Unternehmensanleihe – Eine Anleihe, die von einem Unternehmen begeben wird, um zur Expansion seines Geschäfts effektiv Geld zu beschaffen.

[ix] Aktien – Eigentumsbeteiligung an einer Gesellschaft in Form von Stammaktien oder Vorzugsaktien.

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Asset-Backed Securities – 3,31 % (28. Februar 2019: 3,92 %)			
310	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Serie 2019 1A, Klasse A2I, 144A, 4,194 %, due 6/7/2049	319	0,17
415	Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Certificates Serie 2003-W7, Serie 2003 W3, Klasse M1, 3,270 %, due 9/25/2033 *	411	0,22
–	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2004-D, Serie 2004 D, Klasse M3, 3,715 %, due 8/28/2044 *	–	–
138	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Serie 2001 HE22, Klasse A1, 2,625 %, due 2/25/2032 *	136	0,07
55	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2007-13, Serie 2007 13, Klasse 2A2, 2,945 %, due 10/25/2047 *	53	0,03
217	CWABS Inc Asset-Backed Certificates Trust 2004-5, Serie 2004 5, Klasse 2A, 2,645 %, due 10/25/2034 *	216	0,11
72	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2006-F, Serie 2006 F, Klasse 2A1A, 2,335 %, due 7/15/2036 *	70	0,04
539	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2006-I, Serie 2006 I, Klasse 1A, 2,335 %, due 1/15/2037 *	519	0,27
411	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2006-I, Serie 2006 I, Klasse 2A, 2,335 %, due 1/15/2037 *	396	0,21
151	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2007-B, Serie 2007 B, Klasse A, 2,345 %, due 2/15/2037 *	147	0,08
450	EFS Volunteer No 2 LLC, Serie 2012 1, Klasse A2, 144A, 3,495 %, due 3/25/2036 *	454	0,24
160	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Serie 2018 4, Klasse A, 4,060 %, due 11/15/2030	180	0,09
200	Hertz Vehicle Financing LLC, Serie 2015 1X, Klasse B, 3,520 %, due 3/25/2021	201	0,11
336	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Serie 2006-HE1, Serie 2006 HE1, Klasse M1, 2,535 %, due 12/25/2036 *	336	0,18
450	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-NC2, Serie 2005 NC2, Klasse M4, 3,060 %, due 3/25/2035 *	453	0,24
712	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS, Serie 2018 2GS, Klasse A, 144A, 4,200 %, due 2/22/2044	745	0,39
150	Navient Student Loan Trust 2016-6, Serie 2016 6A, Klasse A3, 144A, 3,445 %, due 3/25/2066 *	153	0,08
200	Navient Student Loan Trust 2017-1, Serie 2017 1A, Klasse A3, 144A, 3,295 %, due 7/26/2066 *	203	0,11
189	NovaStar Mortgage Funding Trust-Serie 2003-3, Serie 2003 3, Klasse A1, 2,855 %, due 12/25/2033 *	188	0,10
67	Option One Mortgage Loan Trust 2002-3, Serie 2002 3, Klasse A2, 2,685 %, due 8/25/2032 *	66	0,03
113	RASC Serie 2005-KS12 Trust, Serie 2005 KS12, Klasse M1, 2,585 %, due 1/25/2036 *	114	0,06
162	SBA Small Business Investment Cos, Serie 2018 10B, Klasse 1, 3,548 %, due 9/10/2028	173	0,09
505	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2005-OP1, Serie 2005 OP1, Klasse M1, 2,760 %, due 1/25/2035 *	499	0,26
186	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A, Serie 2007 A, Klasse A4A, 2,650 %, due 12/16/2041 *	181	0,10
62	Structured Asset Investment Loan Trust 2004-8, Serie 2004 8, Klasse M1, 3,045 %, due 9/25/2034 *	61	0,03
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 6.147)		6.274	3,31
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 47,11 % (28. Februar 2019: 50,71 %)			
170	Banc of America Hypothek 2003-C Trust, Serie 2003 C, Klasse B1, 5,142 %, due 4/25/2033 *	69	0,04
113	Bear Stearns Alt-A Trust 2004-6, Serie 2004 6, Klasse M1, 2,970 %, due 7/25/2034 *	111	0,06
11.065	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust, Serie 2018 B5, Klasse XA, 0,648 %, due 7/15/2051 *	397	0,21
879	BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Klasse A, 144A, 3,445 %, due 7/15/2035 *	881	0,46
100	CD 2017-CD3 Mortgage Trust, Serie 2017 CD3, Klasse A4, 3,631 %, due 2/10/2050	110	0,06
150	COMM 2012-CCRE4 Mortgage Trust, Serie 2012 CR4, Klasse AM, 3,251 %, due 10/15/2045	151	0,08
10	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Serie 2013 CR12, Klasse AM, 4,300 %, due 10/10/2046	11	0,01
202	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Serie 2014 UBS2, Klasse XA, 1,366 %, due 3/10/2047 *	8	–
150	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust, Serie 2015 LC19, Klasse ASB, 3,040 %, due 2/10/2048	154	0,08
530	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust, Serie 2018 COR3, Klasse A3, 4,228 %, due 5/10/2051	610	0,32
100	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Serie 2015 C1, Klasse AS, 3,791 %, due 4/15/2050 *	108	0,06
340	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse A2, 144A, 3,953 %, due 9/15/2037	369	0,19
420	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse B, 144A, 4,185 %, due 9/15/2037	449	0,24
1.523	CSMC Trust 2018-J1, Serie 2018 J1, Klasse A2, 144A 3,500 %, due 2/25/2048 *	1.534	0,81
1.125	CSMC Trust 2018-J1, Serie 2018 J1, Klasse B2, 144A, 3,680 %, due 2/25/2048 *	1.165	0,61
233	CSMC Trust 2018-PLUM, Serie 2018 PLUM, Klasse A, 144A, 5,427 %, due 8/15/2020 *	233	0,12
419	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2014 C03, Klasse 1M2, 5,145 %, due 7/25/2024 *	440	0,23
95	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2014 C04, Klasse 2M2, 7,145 %, due 11/25/2024 *	101	0,05
3	Fannie Mae Interest Strip 390, Klasse C3, 6,000 %, due 7/25/2038	1	–
8	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 41, 6,000 %, due 1/25/2038	2	–
27	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C13, 3,500 %, due 11/25/2041	3	–
24	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C18, 4,000 %, due 4/25/2042	3	–
22	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C2, 3,000 %, due 4/25/2027	2	–
1.300	Fannie Mae oder Freddie Mac, 15 year, TBA, 3,500 % ±	1.347	0,71
500	Fannie Mae oder Freddie Mac, 15 year, TBA, 2,500 % ±	507	0,27
500	Fannie Mae oder Freddie Mac, 15 year, TBA, 3,000 % ±	513	0,27
500	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	526	0,28
500	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,000 % ±	534	0,28
200	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000 % ±	208	0,11
2.300	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	2.346	1,24
3	Fannie Mae Pool '888795', 5,500 %, due 11/1/2036	3	–
86	Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, due 10/1/2044	93	0,05
142	Fannie Mae Pool 'AB6201', 3,000 %, due 9/1/2042	147	0,08
48	Fannie Mae Pool 'AB9594', 4,000 %, due 6/1/2043	52	0,03
340	Fannie Mae Pool 'AH4536', 4,000 %, due 2/1/2041	364	0,19
19	Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, due 5/1/2040	22	0,01
156	Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, due 10/1/2046	161	0,09
80	Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, due 12/1/2046	83	0,04
20	Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, due 4/1/2025	21	0,01
100	Fannie Mae Pool 'AO7501', 4,000 %, due 6/1/2042	107	0,06
46	Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, due 9/1/2042	47	0,03
102	Fannie Mae Pool 'AP9633', 2,500 %, due 10/1/2042	103	0,05
181	Fannie Mae Pool 'AS6328', 3,500 %, due 12/1/2045	188	0,10
868	Fannie Mae Pool 'AS7313', 3,500 %, due 6/1/2046	905	0,48
169	Fannie Mae Pool 'AS7738', 3,000 %, due 8/1/2046	174	0,09
154	Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000 %, due 9/1/2046	159	0,08
878	Fannie Mae Pool 'AS8269', 3,000 %, due 11/1/2046	903	0,48

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
151	Fannie Mae Pool 'AS8359', 3,000 %, due 11/1/2046	156	0,08
81	Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, due 2/1/2047	84	0,04
76	Fannie Mae Pool 'AS9453', 4,000 %, due 4/1/2047	81	0,04
162	Fannie Mae Pool 'AS9588', 4,000 %, due 5/1/2047	172	0,09
56	Fannie Mae Pool 'AT4281', 4,000 %, due 6/1/2043	60	0,03
18	Fannie Mae Pool 'AW3971', 4,500 %, due 4/1/2044	19	0,01
85	Fannie Mae Pool 'BC0884', 3,000 %, due 5/1/2046	88	0,05
153	Fannie Mae Pool 'BC1509', 3,000 %, due 8/1/2046	157	0,08
227	Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000 %, due 9/1/2046	234	0,12
80	Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000 %, due 1/1/2047	82	0,04
77	Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, due 10/1/2046	80	0,04
257	Fannie Mae Pool 'BE2981', 3,000 %, due 2/1/2032	264	0,14
367	Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, due 2/1/2056	389	0,20
440	Fannie Mae Pool 'BF0133', 4,000 %, due 8/1/2056	465	0,25
230	Fannie Mae Pool 'BF0145', 3,500 %, due 3/1/2057	240	0,13
124	Fannie Mae Pool 'BF0163', 5,000 %, due 11/1/2046	134	0,07
155	Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, due 1/1/2057	164	0,09
406	Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, due 6/1/2057	430	0,23
252	Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, due 9/1/2057	272	0,14
716	Fannie Mae Pool 'BH2623', 4,000 %, due 8/1/2047	751	0,40
1.481	Fannie Mae Pool 'BH4101', 3,500 %, due 10/1/2047	1.533	0,81
100	Fannie Mae Pool 'BL2379', 3,090 %, due 5/1/2029	109	0,06
40	Fannie Mae Pool 'BL2454', 3,160 %, due 5/1/2029	43	0,02
40	Fannie Mae Pool 'BL2456', 3,260 %, due 5/1/2029	44	0,02
30	Fannie Mae Pool 'BL2457', 3,260 %, due 5/1/2029	33	0,02
80	Fannie Mae Pool 'BL2465', 3,240 %, due 5/1/2029	87	0,05
100	Fannie Mae Pool 'BL3643', 2,915 %, due 8/1/2031	107	0,06
400	Fannie Mae Pool 'BL3644', 2,850 %, due 8/1/2031	423	0,22
100	Fannie Mae Pool 'BL3648', 2,850 %, due 8/1/2031	106	0,06
100	Fannie Mae Pool 'BL3677', 2,930 %, due 8/1/2031	107	0,06
100	Fannie Mae Pool 'BL3681', 2,860 %, due 8/1/2031	106	0,06
286	Fannie Mae Pool 'BM3473', 3,500 %, due 11/1/2047	300	0,16
72	Fannie Mae Pool 'BM3904', 5,000 %, due 5/1/2048	77	0,04
664	Fannie Mae Pool 'BM4579', 3,000 %, due 4/1/2047	685	0,36
89	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, due 3/1/2043	94	0,05
183	Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, due 12/1/2046	192	0,10
1.118	Fannie Mae Pool 'BM4918', 4,000 %, due 11/1/2048	1.165	0,61
370	Fannie Mae Pool 'BM5521', 3,500 %, due 7/1/2048	385	0,20
2.179	Fannie Mae Pool 'BM5526', 3,500 %, due 2/1/2048	2.257	1,19
489	Fannie Mae Pool 'BN5424', 3,500 %, due 4/1/2049	505	0,27
200	Fannie Mae Pool 'BN7652', 3,000 %, due 7/1/2049	206	0,11
99	Fannie Mae Pool 'BN9558', 3,000 %, due 7/1/2049	101	0,05
194	Fannie Mae Pool 'BN9760', 3,500 %, due 5/1/2049	199	0,11
100	Fannie Mae Pool 'BO3074', 3,000 %, due 8/1/2049	102	0,05
200	Fannie Mae Pool 'BO3815', 3,000 %, due 8/1/2049	204	0,11
267	Fannie Mae Pool 'CA0858', 3,500 %, due 12/1/2047	277	0,15
187	Fannie Mae Pool 'CA1050', 3,000 %, due 1/1/2048	192	0,10
1.192	Fannie Mae Pool 'CA1692', 4,000 %, due 5/1/2048	1.267	0,67
584	Fannie Mae Pool 'CA2652', 5,000 %, due 11/1/2048	626	0,33
98	Fannie Mae Pool 'CA3471', 3,500 %, due 5/1/2049	102	0,05
99	Fannie Mae Pool 'CA3478', 3,500 %, due 5/1/2049	102	0,05
199	Fannie Mae Pool 'CA3634', 3,500 %, due 6/1/2049	208	0,11
99	Fannie Mae Pool 'CA3637', 3,500 %, due 6/1/2049	102	0,05
100	Fannie Mae Pool 'CA3809', 3,000 %, due 7/1/2049	103	0,05
499	Fannie Mae Pool 'CA4017', 3,000 %, due 8/1/2049	511	0,27
200	Fannie Mae Pool 'CA4078', 3,000 %, due 9/1/2049	204	0,11
800	Fannie Mae Pool 'CA4110', 3,000 %, due 9/1/2049	825	0,43
900	Fannie Mae Pool 'CA4121', 3,000 %, due 9/1/2049	925	0,49
100	Fannie Mae Pool 'FM1341', 3,000 %, due 8/1/2049	102	0,05
94	Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000 %, due 10/1/2042	100	0,05
46	Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000 %, due 11/1/2042	49	0,03
53	Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, due 9/1/2043	58	0,03
1.102	Fannie Mae Pool 'MA2806', 3,000 %, due 11/1/2046	1.135	0,60
361	Fannie Mae Pool 'MA3383', 3,500 %, due 6/1/2048	373	0,20
472	Fannie Mae Pool 'MA3501', 5,000 %, due 10/1/2048	504	0,27
1.568	Fannie Mae Pool 'MA3686', 3,500 %, due 6/1/2049	1.614	0,85
21	Fannie Mae REMICS, Serie 2001 81, Klasse GE, 6,000 %, due 1/25/2032	24	0,01
32	Fannie Mae REMICS, Serie 2005 29, Klasse ZA, 5,500 %, due 4/25/2035	36	0,02
27	Fannie Mae REMICS, Serie 2011 87, Klasse SG, 4,405 %, due 4/25/2040 *	3	–
76	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 101, Klasse AI, 3,000 %, due 6/25/2027	4	–
199	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 134, Klasse SK, 4,005 %, due 12/25/2042 *	34	0,02
13	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 46, Klasse BA, 6,000 %, due 5/25/2042	15	0,01
21	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 70, Klasse YS, 4,505 %, due 2/25/2041 *	2	–
21	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 75, Klasse NS, 4,455 %, due 7/25/2042 *	4	–
1.107	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 96, Klasse SB, 3,905 %, due 9/25/2042 *	164	0,09
19	Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, due 7/25/2042	22	0,01
27	Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, due 4/25/2042	30	0,02
400	Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ∞±	412	0,22
600	Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ∞±	616	0,32
4.127	Fannie Mae-Aces, Serie 2015 M3, Klasse X2, 0,461 %, due 10/25/2024 *	65	0,03
78	Freddie Mac Gold Pool 'C91240', 4,500 %, due 1/1/2029	83	0,04
21	Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000 %, due 11/1/2039	24	0,01
10	Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, due 9/1/2039	12	0,01
16	Freddie Mac Gold Pool 'G07117', 6,000 %, due 10/1/2036	18	0,01
164	Freddie Mac Gold Pool 'G08747', 3,000 %, due 2/1/2047	168	0,09
35	Freddie Mac Gold Pool 'G14492', 4,000 %, due 10/1/2025	37	0,02
731	Freddie Mac Gold Pool 'G16568', 2,500 %, due 4/1/2033	742	0,39
90	Freddie Mac Gold Pool 'G61587', 3,000 %, due 4/1/2047	93	0,05
284	Freddie Mac Gold Pool 'G61637', 3,000 %, due 9/1/2047	293	0,15
376	Freddie Mac Gold Pool 'G61739', 3,000 %, due 9/1/2048	389	0,21
575	Freddie Mac Gold Pool 'J39656', 3,000 %, due 9/1/2033	590	0,31
49	Freddie Mac Gold Pool 'Q17792', 3,500 %, due 5/1/2043	52	0,03
128	Freddie Mac Gold Pool 'Q29184', 4,000 %, due 10/1/2044	136	0,07
82	Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000 %, due 1/1/2047	84	0,04
158	Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000 %, due 1/1/2047	164	0,09
81	Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, due 1/1/2047	84	0,04
145	Freddie Mac Gold Pool 'Q46955', 4,500 %, due 3/1/2047	153	0,08
88	Freddie Mac Gold Pool 'Q55429', 4,000 %, due 4/1/2048	92	0,05
529	Freddie Mac Gold Pool 'Q55997', 4,000 %, due 5/1/2048	553	0,29
438	Freddie Mac Gold Pool 'Q56683', 3,000 %, due 4/1/2048	449	0,24
1.252	Freddie Mac Gold Pool 'Q56836', 4,500 %, due 6/1/2048	1.325	0,70
2.460	Freddie Mac Gold Pool 'Q57142', 4,000 %, due 7/1/2048	2.567	1,35
46	Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, due 10/1/2042	49	0,03
59	Freddie Mac Gold Pool 'U90503', 3,500 %, due 11/1/2042	62	0,03
52	Freddie Mac Gold Pool 'U99045', 3,500 %, due 3/1/2043	54	0,03
141	Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, due 3/1/2045	148	0,08
189	Freddie Mac Gold Pool 'V61952', 2,500 %, due 3/1/2033	193	0,10
82	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Zertifikate K016, Klasse X1, 1,635 %, due 10/25/2021 *	2	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
12.600	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Zertifikate K053, Klasse X1, 1,025 %, due 12/25/2025 *	611	0,32
5.827	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Zertifikate K725, Klasse X1, 0,841 %, due 1/25/2024 *	158	0,08
90	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Zertifikate Q006, Klasse A2, 4,843 %, due 4/25/2028 *	104	0,05
99	Freddie Mac Pool 'QA0794', 3,000 %, due 7/1/2049	101	0,05
398	Freddie Mac Pool 'QA1033', 3,000 %, due 7/1/2049	406	0,21
300	Freddie Mac Pool 'QA1597', 3,000 %, due 8/1/2049	306	0,16
100	Freddie Mac Pool 'QA1627', 3,000 %, due 8/1/2049	102	0,05
100	Freddie Mac Pool 'QA2090', 3,000 %, due 8/1/2049	102	0,05
198	Freddie Mac Pool 'RA1103', 3,000 %, due 7/1/2049	204	0,11
200	Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000 %, due 9/1/2049	207	0,11
200	Freddie Mac Pool 'RA1343', 3,000 %, due 9/1/2049	206	0,11
400	Freddie Mac Pool 'RA1352', 3,000 %, due 9/1/2049	409	0,22
98	Freddie Mac Pool "ZA6498", 3,500 %, due 3/1/2049	102	0,05
17	Freddie Mac Pool 'ZI7269', 5,000 %, due 3/1/2038	19	0,01
613	Freddie Mac Pool 'ZM7235', 4,000 %, due 7/1/2048	640	0,34
185	Freddie Mac Pool 'ZM7377', 3,500 %, due 7/1/2048	191	0,10
85	Freddie Mac Pool 'ZM8774', 5,000 %, due 10/1/2048	91	0,05
79	Freddie Mac Pool 'ZN1436', 5,000 %, due 11/1/2048	85	0,04
9	Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, due 12/1/2038	10	0,01
76	Freddie Mac Pool 'ZS4727', 4,000 %, due 7/1/2047	80	0,04
1.346	Freddie Mac Pool 'ZS4735', 3,500 %, due 9/1/2047	1.394	0,73
87	Freddie Mac Pool 'ZS4755', 3,500 %, due 2/1/2048	90	0,05
1.923	Freddie Mac Pool 'ZS4758', 3,000 %, due 3/1/2048	1.972	1,04
1.443	Freddie Mac Pool 'ZS4790', 4,000 %, due 9/1/2048	1.498	0,79
1.090	Freddie Mac Pool 'ZT0711', 3,500 %, due 10/1/2048	1.124	0,59
79	Freddie Mac Pool 'ZT0714', 5,000 %, due 10/1/2048	84	0,04
368	Freddie Mac Pool 'ZT1481', 4,000 %, due 11/1/2048	383	0,20
750	Freddie Mac Pool 'ZT1596', 5,000 %, due 1/1/2049	801	0,42
533	Freddie Mac Pool 'ZT1709', 3,500 %, due 2/1/2049	548	0,29
191	Freddie Mac Pool 'ZT1863', 3,500 %, due 4/1/2049	196	0,10
483	Freddie Mac Pool 'ZT1867', 3,000 %, due 4/1/2049	493	0,26
9	Freddie Mac REMICS 3621, Klasse SB, 4,035 %, due 1/15/2040 *	1	–
55	Freddie Mac REMICS 3947, Klasse SG, 3,755 %, due 10/15/2041 *	8	–
21	Freddie Mac REMICS 4057, Klasse CS, 3,855 %, due 4/15/2039 *	1	–
125	Freddie Mac REMICS 4194, Klasse BI, 3,500 %, due 4/15/2043	13	0,01
27	Freddie Mac REMICS 4298, Klasse PI, 4,000 %, due 4/15/2043	2	–
296	Freddie Mac REMICS 4813, Klasse CJ, 3,000 %, due 8/15/2048	297	0,16
122	Freddie Mac Structured Kreditrisikorisiko der Agentur Notes, Serie 2014 DN1, Klasse M2, 4,345 %, due 2/25/2024 *	124	0,07
48	Freddie Mac Structured Kreditrisikorisiko der Agentur Notes, Serie 2015 DNA2, Klasse M2, 4,745 %, due 12/25/2027 *	48	0,03
93	Freddie Mac Structured Kreditrisikorisiko der Agentur Notes, Serie 2015 DNA3, Klasse M2, 4,995 %, due 4/25/2028 *	94	0,05
279	Freddie Mac Structured Kreditrisikorisiko der Agentur Notes, Serie 2016 DNA4, Klasse M2, 3,445 %, due 3/25/2029 *	280	0,15
99	Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates, Serie T 56, Klasse 2AF, 2,545 %, due 5/25/2043 *	98	0,05
600	Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ∞±	615	0,32
500	Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ∞±	511	0,27
300	Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ∞±	307	0,16
1	Ginnie Mae I Pool '464051', 7,000 %, due 7/15/2028	1	–
25	Ginnie Mae I Pool '557522', 7,000 %, due 7/15/2031	29	0,02
13	Ginnie Mae I Pool '565347', 7,000 %, due 8/15/2031	13	0,01
15	Ginnie Mae I Pool '584344', 7,000 %, due 4/15/2032	17	0,01
174	Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, due 6/15/2048	183	0,10
84	Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, due 9/15/2042	88	0,05
155	Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, due 9/15/2042	161	0,08
305	Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, due 10/15/2042	316	0,17
108	Ginnie Mae I Pool 'AB9205', 3,000 %, due 11/15/2042	112	0,06
22	Ginnie Mae II Pool '4837', 6,000 %, due 10/20/2040	25	0,01
17	Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, due 1/20/2041	18	0,01
15	Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, due 2/20/2041	17	0,01
43	Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, due 3/20/2041	47	0,02
20	Ginnie Mae II Pool '5240', 6,000 %, due 11/20/2041	22	0,01
1.325	Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, due 7/20/2047	1.396	0,74
87	Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, due 10/20/2047	91	0,05
77	Ginnie Mae II Pool 'BJ1835', 4,500 %, due 9/20/2048	80	0,04
157	Ginnie Mae II Pool 'BJ1853', 4,500 %, due 9/20/2048	162	0,09
96	Ginnie Mae II Pool 'MA 1995', 3,500 %, due 6/20/2044	101	0,05
38	Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, due 3/20/2045	39	0,02
64	Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500 %, due 9/20/2046	67	0,04
398	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, due 6/20/2047	418	0,22
456	Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, due 11/20/2047	478	0,25
51	Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, due 12/20/2047	53	0,03
309	Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, due 12/20/2047	324	0,17
47	Ginnie Mae II Pool 'MA5018', 3,000 %, due 2/20/2048	49	0,03
519	Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, due 2/20/2048	541	0,29
159	Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, due 2/20/2048	166	0,09
239	Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, due 3/20/2048	250	0,13
161	Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, due 4/20/2048	168	0,09
631	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, due 6/20/2048	662	0,35
333	Ginnie Mae II Pool 'MA5330', 4,000 %, due 7/20/2048	348	0,18
302	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, due 7/20/2048	317	0,17
861	Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, due 9/20/2048	902	0,48
1.273	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, due 1/20/2049	1.333	0,70
1.519	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000 %, due 1/20/2049	1.598	0,84
97	Ginnie Mae II Pool 'MA5762', 3,500 %, due 2/20/2049	100	0,05
585	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, due 3/20/2049	613	0,32
298	Ginnie Mae II Pool 'MA5931', 4,000 %, due 5/20/2049	311	0,16
100	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ±	103	0,05
5.300	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 % ±	5.507	2,90
300	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,000 % ±	313	0,16
1.400	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,500 % ±	1.465	0,77
10	Government National Mortgage Association, Serie 2007 51, Klasse SG, 4,408 %, due 8/20/2037 *	2	–
40	Government National Mortgage Association, Serie 2009 H01, Klasse FA, 3,322 %, due 11/20/2059 *	41	0,02
10	Government National Mortgage Association, Serie 2010 85, Klasse HS, 4,478 %, due 1/20/2040 *	1	–
44	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H26, Klasse LF, 2,730 %, due 8/20/2058 *	44	0,02
65	Government National Mortgage Association, Serie 2011 H01, Klasse AF, 2,830 %, due 11/20/2060 *	65	0,03
102	Government National Mortgage Association, Serie 2011 H09, Klasse AF, 2,880 %, due 3/20/2061 *	102	0,05
248	Government National Mortgage Association, Serie 2012 112, Klasse IO, 0,278 %, due 2/16/2053 *	5	–
139	Government National Mortgage Association, Serie 2012 27, Klasse IO, 0,948 %, due 4/16/2053 *	4	–
37	Government National Mortgage Association, Serie 2012 34, Klasse SA, 3,878 %, due 3/20/2042 *	7	–
126	Government National Mortgage Association, Serie 2012 44, Klasse IO, 0,403 %, due 3/16/2049 *	2	–
71	Government National Mortgage Association, Serie 2012 66, Klasse CI, 3,500 %, due 2/20/2038	3	–
48	Government National Mortgage Association, Serie 2012 H18, Klasse NA, 2,900 %, due 8/20/2062 *	48	0,03
97	Government National Mortgage Association, Serie 2012 H27, Klasse AI, 1,740 %, due 10/20/2062 *	5	–
57	Government National Mortgage Association, Serie 2012 H30, Klasse GA, 2,730 %, due 12/20/2062 *	57	0,03

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
113	Government National Mortgage Association, Serie 2013 145, Klasse IO, 1,063 %, due 9/16/2044 *	5	–
117	Government National Mortgage Association, Serie 2013 163, Klasse IO, 1,239 %, due 2/16/2046 *	6	–
195	Government National Mortgage Association, Serie 2013 H08, Klasse BF, 2,780 %, due 3/20/2063 *	194	0,10
802	Government National Mortgage Association, Serie 2014 105, Klasse IO, 0,955 %, due 6/16/2054 *	38	0,02
50	Government National Mortgage Association, Serie 2014 47, Klasse IA, 0,127 %, due 2/16/2048 *	1	–
141	Government National Mortgage Association, Serie 2014 50, Klasse IO, 0,826 %, due 9/16/2055 *	7	–
508	Government National Mortgage Association, Serie 2014 92, Klasse IX, 0,623 %, due 5/16/2054 *	13	0,01
834	Government National Mortgage Association, Serie 2014 H20, Klasse FA, 2,810 %, due 10/20/2064 *	833	0,44
112	Government National Mortgage Association, Serie 2015 167, Klasse OI, 4,000 %, due 4/16/2045	17	0,01
74	Government National Mortgage Association, Serie 2015 36, Klasse MI, 5,500 %, due 3/20/2045	13	0,01
1.392	Government National Mortgage Association, Serie 2015 5, Klasse IK, 0,665 %, due 11/16/2054 *	54	0,03
908	Government National Mortgage Association, Serie 2016 128, Klasse IO, 0,952 %, due 9/16/2056 *	67	0,04
520	GS Mortgage Securities Corp II, Serie 2018 SRP5, Klasse A, 144A, 3,495 %, due 9/15/2031 *	515	0,27
900	GS Mortgage Securities Corp II, Serie 2018 SRP5, Klasse B, 144A, 4,695 %, due 9/15/2031 *	890	0,47
10	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16, Serie 2013 GC16, Klasse B, 5,161 %, due 11/10/2046 *	11	0,01
132	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-9, Serie 2005 9, Klasse 2A1B, 2,542 %, due 6/20/2035 *	132	0,07
450	Independence Plaza Trust 2018-INDP, Serie 2018 INDP, KLASSE A, 144A, 3,763 %, due 7/10/2035	485	0,26
10	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, Serie 2013 C17, Klasse B 5,054 %, due 1/15/2047 *	11	0,01
120	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, Serie 2014 C23, Klasse AS, 4,202 %, due 9/15/2047 *	131	0,07
13.749	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2018-C8, Serie 2018 C8, Klasse XA, 0,810 %, due 6/15/2051 *	581	0,31
100	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18, Serie 2014 C18, Klasse AS, 4,110 %, due 10/15/2047 *	109	0,06
80	Morgan Stanley Capital I Trust 2012-C4, Serie 2012 C4, Klasse A4, 3,244 %, due 3/15/2045	82	0,04
250	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, Serie 2017 ASHF, Klasse A, 144A, 3,045 %, due 11/15/2034 *	249	0,13
550	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse A, 144A, 3,047 %, due 8/5/2024 ∞	566	0,30
80	Sequoia Mortgage Trust 2003-5, Serie 2003 5, Klasse A1, 2,792 %, due 9/20/2033 *	81	0,04
13	Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4, Serie 2007 4, Klasse 1A1, 4,075 %, due 9/25/2037 *	13	0,01
1.425	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, Serie 2015 NXS1, Klasse XA, 1,276 %, due 5/15/2048 *	60	0,03
1.728	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Serie 2016 C36, Klasse XA, 1,462 %, due 11/15/2059 *	121	0,06
140	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RC1, Serie 2017 RC1, Klasse A2, 3,118 %, due 1/15/2060	143	0,08
22	Wells Fargo Mortgage Backed Securities 2004-I Trust, Serie 2004 I, Klasse B2, 4,941 %, due 7/25/2034 *	21	0,01
1.879	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23, Serie 2014 C23, Klasse XA, 0,738 %, due 10/15/2057 *	45	0,02
90	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Serie 2014 LC14, Klasse ASB, 3,522 %, due 3/15/2047	93	0,05
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 87.680)		89.436	47,11
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 31,85 % (28. Februar 2019: 34,37 %)			
Australien – 0,19 % (28. Februar 2019: 0,31 %)			
105	Bhp Billiton Finance USA Ltd, 2,875 %, due 2/24/2022	108	0,06
140	Bhp Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, due 9/30/2043	185	0,10
10	Commonwealth Bank of Australien, 5,000 %, due 10/15/2019	10	–
50	Westpac Banking Corp, 2,600 %, due 11/23/2020	50	0,03
		353	0,19
Belgien – 0,64 % (28. Februar 2019: 0,75 %)			
370	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev NV Worldwide Inc, 3,650 %, due 2/1/2026	398	0,21
15	Anheuser-Busch InBev NV Finance Inc, 2,650 %, due 2/1/2021	15	0,01
27	Anheuser-Busch InBev NV Finanzwesen, Inc., 3,300 %, due 2/1/2023	28	0,01
70	Anheuser-Busch InBev NV Worldwide Inc, 4,150 %, due 1/23/2025	77	0,04
160	Anheuser-Busch InBev NV Worldwide Inc, 4,000 %, due 4/13/2028	177	0,09
350	Anheuser-Busch InBev NV Worldwide Inc, 4,750 %, due 1/23/2029	409	0,22
100	Anheuser-Busch InBev NV Worldwide Inc, 4,439 %, due 10/6/2048	114	0,06
		1.218	0,64
Brasilien – 0,52 % (28. Februar 2019: 0,58 %)			
10	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, due 3/17/2024	11	0,01
50	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, due 6/5/2115	56	0,03
290	Suzano Austria GmbH, 6,000 %, due 1/15/2029	322	0,17
270	Vale Overseas Ltd, 6,250 %, due 8/10/2026	313	0,17
20	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, due 11/21/2036	25	0,01
200	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, due 11/10/2039	253	0,13
		980	0,52
Kanada – 0,34 % (28. Februar 2019: 0,39 %)			
30	Bank of Montreal, 3,803 %, due 12/15/2032 *	31	0,02
40	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, due 5/30/2041	52	0,03
110	Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, due 10/15/2039	146	0,08
10	Nutrien Ltd, 4,875 %, due 3/30/2020	10	–
200	Royal Bank of Canada 1,875 %, due 2/5/2020	200	0,10
40	Royal Bank of Canada 2,150 %, due 10/26/2020	40	0,02
50	Royal Bank of Canada 3,200 %, due 4/30/2021	51	0,03
110	Toronto-Dominion Bank/The, 3,250 %, due 6/11/2021	113	0,06
		643	0,34
Chile – 0,11 % (28. Februar 2019: 0,13 %)			
200	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,625 %, due 8/1/2027	214	0,11
China – 0,37 % (28. Februar 2019: 0,43 %)			
200	CNOOC Finance 2015 USA LLC, 3,500 %, due 5/5/2025	210	0,11
200	CNOOC Finance 2015 USA LLC, 4,375 %, due 5/2/2028	225	0,12
250	Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 4,375 %, due 4/10/2024	272	0,14
		707	0,37
Kolumbien – 0,40 % (28. Februar 2019: 0,42 %)			
650	Ecopetrol SA, 5,875 %, due 5/28/2045	766	0,40
Dänemark – 0,23 % (28. Februar 2019: 0,13 %)			
200	Danske Bank A/S, 144A, 5,000 %, due 1/12/2022	211	0,11
200	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, due 1/12/2024	221	0,12
		432	0,23
Frankreich – 0,74 % (28. Februar 2019: 0,71 %)			
470	BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, due 1/10/2025 *	509	0,27
200	BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, due 8/14/2028	224	0,12
400	BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, due 1/10/2030 *	472	0,25
200	Danone SA, 2,589 %, due 11/2/2023	204	0,10
		1.409	0,74
Indonesien – 0,12 % (28. Februar 2019: 0,12 %)			
200	Perusahaan Listrik Negara PT, 5,250 %, due 10/24/2042	233	0,12
Irland – 0,15 % (28. Februar 2019: 0,19 %)			
280	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 5,000 %, due 10/1/2021	294	0,15
Italien – 0,26 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
180	Intesa Sanpaolo SpA, Serie 0000, 144A, 6,500 %, due 2/24/2021	189	0,10

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Italien - (Fortsetzung)			
300	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,125 %, due 7/14/2022	302	0,16
		491	0,26
Kasachstan – 0,15 % (28. Februar 2019: 0,17 %)			
250	KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, due 4/24/2030	290	0,15
Kuwait – 0,11 % (28. Februar 2019: 0,13 %)			
200	Equate Petrochemical BV, 4,250 %, due 11/3/2026	217	0,11
Luxemburg – 0,17 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
300	ArcelorMittal, 4,550 %, due 3/11/2026	315	0,17
Macau – 0,12 % (28. Februar 2019: 0,13 %)			
200	Sands China Ltd, 5,125 %, due 8/8/2025	222	0,12
Mexiko – 0,44 % (28. Februar 2019: 0,50 %)			
100	America Movil SAB de CV, 5,000 %, due 3/30/2020	102	0,05
200	Comision Federal de Electricidad, 4,750 %, due 2/23/2027	209	0,11
10	Petroleos Mexicanos, Serie WI, 3,500 %, due 1/30/2023	10	0,01
440	Petroleos Mexicanos, 6,625 %, due 6/15/2035	430	0,23
20	Petroleos Mexicanos, 6,375 %, due 1/23/2045	18	0,01
70	Petroleos Mexicanos, 5,625 %, due 1/23/2046	60	0,03
		829	0,44
Niederlande – 0,95 % (28. Februar 2019: 1,20 %)			
120	BNG Bank NV, 4,375 %, due 2/16/2021	125	0,07
20	Cooperatieve Rabobank UA, 3,875 %, due 2/8/2022	21	0,01
250	Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, due 8/4/2025	270	0,14
300	Cooperatieve Rabobank UA, 3,750 %, due 7/21/2026	314	0,17
530	Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375 %, due 5/21/2025	572	0,30
80	Shell International Finance BV, 4,375 %, due 3/25/2020	81	0,04
120	Shell International Finance BV, 1,875 %, due 5/10/2021	120	0,06
110	Shell International Finance BV, 2,875 %, due 5/10/2026	115	0,06
10	Shell International Finance BV, 4,550 %, due 8/12/2043	12	0,01
140	Shell International Finance BV, 4,000 %, due 5/10/2046	165	0,09
		1.795	0,95
Peru – 0,53 % (28. Februar 2019: 0,56 %)			
400	Petroleos del Peru SA, 4,750 %, due 6/19/2032	452	0,24
480	Southern Copper Corp, 5,250 %, due 11/8/2042	556	0,29
		1.008	0,53
Südafrika – 0,17 % (28. Februar 2019: 0,19 %)			
290	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, due 4/10/2027	314	0,17
Spanien – 0,52 % (28. Februar 2019: 0,61 %)			
200	Banco Santander SA, 3,848 %, due 4/12/2023	209	0,11
200	Banco Santander SA, 3,800 %, due 2/23/2028	212	0,11
390	Telefonica Emisiones SA, 5,134 %, due 4/27/2020	397	0,21
150	Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, due 3/8/2047	175	0,09
		993	0,52
Schweden – 0,13 % (28. Februar 2019: 0,16 %)			
250	Svenska Handelsbanken AB 3,350 %, due 5/24/2021	256	0,13
Schweiz – 1,01 % (28. Februar 2019: 0,82 %)			
500	Credit Suisse Group AG, 144A, 3,869 %, due 1/12/2029 *	533	0,28
300	Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, due 3/12/2024	316	0,17
10	Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, due 3/27/2027	10	0,01
320	Glencore Funding LLC, 144A, 3,875 %, due 10/27/2027	329	0,17
400	UBS AG/LONDON, 144A, 4,500 %, due 6/26/2048	517	0,27
200	UBS GROUP AG, 144A, 3,126 %, due 8/13/2030 *	205	0,11
		1.910	1,01
Vereinigte Arabische Emirate – 0,21 % (28. Februar 2019: 0,22 %)			
330	DP World Plc, 144A, 5,625 %, due 9/25/2048	394	0,21
Großbritannien – 2,33 % (28. Februar 2019: 2,57 %)			
200	Barclays Plc, 4,972 %, due 5/16/2029 *	220	0,12
130	BAT Capital Corp, 4,540 %, due 8/15/2047	130	0,07
10	BP Capital Markets Plc, 3,535 %, due 11/4/2024	11	–
70	Diageo Capital Plc, 4,828 %, due 7/15/2020	72	0,04
350	HSBC Holdings Plc, 4,300 %, due 3/8/2026	381	0,20
410	HSBC Holdings Plc, 4,041 %, due 3/13/2028 *	438	0,23
400	HSBC Holdings Plc, 4,583 %, due 6/19/2029 *	447	0,24
200	HSBC Holdings Plc, 3,973 %, due 5/22/2030 *	215	0,11
200	Lloyds Banking Group Plc 3,100 %, due 7/6/2021	203	0,11
200	Lloyds Banking Group Plc 2,907 %, due 11/7/2023 *	201	0,11
200	Lloyds Banking Group Plc 4,650 %, due 3/24/2026	211	0,11
200	Lloyds Banking Group Plc 4,375 %, due 3/22/2028	218	0,11
200	Nationwide Building Society, 144A, 4,363 %, due 8/1/2024 *	210	0,11
211	Reynolds American Inc, 3,250 %, due 6/12/2020	213	0,11
270	Reynolds American Inc, 5,850 %, due 8/15/2045	304	0,16
200	Royal Bank of Scotland Group Plc, 4,519 %, due 6/25/2024 *	210	0,11
200	Royal Bank of Scotland Group Plc, 4,269 %, due 3/22/2025 *	209	0,11
200	Royal Bank of Scotland Group Plc, 4,892 %, due 5/18/2029 *	220	0,11
30	Santander UK Plc, 2,375 %, due 3/16/2020	30	0,02
250	Vodafone Group Plc, 4,375 %, due 5/30/2028	281	0,15
		4.424	2,33
USA – 20,94 % (28. Februar 2019: 22,95 %)			
260	3M Co, 2,375 %, due 8/26/2029	260	0,14
68	Abbott Laboratories, 3,750 %, due 11/30/2026	75	0,04
10	Abbott Laboratories, 4,750 %, due 11/30/2036	13	0,01
100	Abbott Laboratories, 4,900 %, due 11/30/2046	134	0,07
20	AbbVie Inc, 3,600 %, due 5/14/2025	21	0,01
10	Aetna Inc, 2,800 %, due 6/15/2023	10	0,01
10	Aetna Inc, 3,875 %, due 8/15/2047	10	–
20	Allergan Funding SCS, 3,450 %, due 3/15/2022	21	0,01
100	Allergan Funding SCS, 3,800 %, due 3/15/2025	105	0,06
110	Altria Group Inc, 4,750 %, due 5/5/2021	115	0,06
40	Altria Group Inc, 3,490 %, due 2/14/2022	41	0,02
40	Altria Group Inc, 2,850 %, due 8/9/2022	41	0,02
40	Altria Group Inc, 3,800 %, due 2/14/2024	42	0,02
130	Altria Group Inc, 4,400 %, due 2/14/2026	143	0,07
290	Altria Group Inc, 4,800 %, due 2/14/2029	328	0,17
100	Altria Group Inc, 5,800 %, due 2/14/2039	124	0,06
100	Altria Group Inc, 3,875 %, due 9/16/2046	98	0,05
140	Altria Group Inc, 5,950 %, due 2/14/2049	180	0,09
60	Altria Group Inc, 6,200 %, due 2/14/2059	77	0,04
200	Amazon.com Inc, 3,150 %, due 8/22/2027	215	0,11
80	Amazon.com Inc, 4,950 %, due 12/5/2044	107	0,06
210	American Express Co, 2,500 %, due 7/30/2024	214	0,11
150	American Express Co, 3,625 %, due 12/5/2024	160	0,08
50	American Express Credit Corp., 2,375 %, due 5/26/2020	50	0,03
100	American International Group Inc, 6,250 %, due 3/15/2037 *	106	0,06
150	American International Group Inc, 4,750 %, due 4/1/2048	179	0,09
10	Amgen Inc, 2,125 %, due 5/1/2020	10	–
11	Amgen Inc, 4,663 %, due 6/15/2051	13	0,01
20	Anadarko Petroleum Corp, 5,550 %, due 3/15/2026	23	0,01
450	Anadarko Petroleum Corp, 4,500 %, due 7/15/2044	464	0,24
20	Anthem Inc, 3,125 %, due 5/15/2022	21	0,01
30	Anthem Inc, 2,950 %, due 12/1/2022	31	0,02
20	Anthem Inc, 3,350 %, due 12/1/2024	21	0,01
190	Anthem Inc, 3,650 %, due 12/1/2027	202	0,11
507	Apache Corp, 3,250 %, due 4/15/2022	517	0,27
20	Apache Corp, 4,375 %, due 10/15/2028	21	0,01
270	Apache Corp, 4,250 %, due 1/15/2044	245	0,13
180	Apple Inc, 2,000 %, due 11/13/2020	181	0,09
100	Apple Inc, 1,550 %, due 8/4/2021	100	0,05
130	Apple Inc, 2,450 %, due 8/4/2026	133	0,07
140	AT&T Inc, 4,350 %, due 6/15/2045	149	0,08
207	AT&T Inc, 4,500 %, due 3/9/2048	227	0,12
10	Bank of America Corp, 3,300 %, due 1/11/2023	10	0,01
35	Bank of America Corp, 3,004 %, due 12/20/2023 *	36	0,02
90	Bank of America Corp, 3,550 %, due 3/5/2024 *	94	0,05
30	Bank of America Corp, 4,000 %, due 4/1/2024	32	0,02
110	Bank of America Corp, 4,200 %, due 8/26/2024	119	0,06
310	Bank of America Corp, 4,000 %, due 1/22/2025	331	0,17

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
10	Bank of America Corp, 4,450 %, due 3/3/2026	11	0,01
50	Bank of America Corp, 3,500 %, due 4/19/2026	54	0,03
300	Bank of America Corp, 4,250 %, due 10/22/2026	328	0,17
180	Bank of America Corp, 3,593 %, due 7/21/2028 *	193	0,10
183	Bank of America Corp, 3,419 %, due 12/20/2028 *	194	0,10
450	Bank of America Corp, 3,970 %, due 3/5/2029 *	495	0,26
140	Bank of America Corp, 5,000 %, due 1/21/2044	182	0,10
290	Bank of America Corp, 3,946 %, due 1/23/2049 *	338	0,18
160	Becton Dickinson and Co, 3,363 %, due 6/6/2024	167	0,09
19	Becton Dickinson and Co, 3,734 %, due 12/15/2024	20	0,01
94	Becton Dickinson and Co, 4,685 %, due 12/15/2044	112	0,06
130	Berkshire Hathaway Finance Corp., 4,250 %, due 1/15/2049	158	0,08
10	Sprint Capital Corp, 4,700 %, due 10/27/2019	10	–
20	Boeing Co/The, 4,875 %, due 2/15/2020	20	0,01
140	Boeing Co/The, 3,250 %, due 2/1/2035	149	0,08
100	Boeing Co/The, 5,875 %, due 2/15/2040	140	0,07
40	Boeing Co/The, 3,750 %, due 2/1/2050	45	0,02
50	BP Capital Markets America Inc, 3,245 %, due 5/6/2022	52	0,03
160	BP Capital Markets America Inc, 3,216 %, due 11/28/2023	167	0,09
40	BP Capital Markets America Inc, 3,410 %, due 2/11/2026	43	0,02
220	BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, due 5/4/2026	231	0,12
90	Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 2,600 %, due 5/16/2022	92	0,05
160	Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 2,900 %, due 7/26/2024	166	0,09
130	Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 3,200 %, due 6/15/2026	137	0,07
70	Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 3,400 %, due 7/26/2029	76	0,04
20	Cardinal Health Inc., 2,616 %, due 6/15/2022	20	0,01
20	Cardinal Health Inc., 3,079 %, due 6/15/2024	20	0,01
40	Celgene Corp, 2,250 %, due 8/15/2021	40	0,02
10	Celgene Corp, 3,550 %, due 8/15/2022	10	0,01
100	Celgene Corp, 3,625 %, due 5/15/2024	106	0,06
60	Celgene Corp, 3,875 %, due 8/15/2025	65	0,03
10	Celgene Corp, 5,250 %, due 8/15/2043	13	0,01
50	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,579 %, due 7/23/2020	50	0,03
460	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, due 3/15/2028	490	0,26
430	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, due 3/30/2029	486	0,26
90	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, due 10/23/2045	111	0,06
100	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, due 4/1/2048	117	0,06
140	Chevron Corp, 2,954 %, due 5/16/2026	148	0,08
10	Chubb INA Holdings Inc., 2,300 %, due 11/3/2020	10	–
10	Chubb INA Holdings Inc., 3,350 %, due 5/3/2026	11	0,01
60	Cigna Corp, 3,400 %, due 9/17/2021	62	0,03
170	Cigna Corp, 3,750 %, due 7/15/2023	179	0,09
150	Cigna Corp, 4,125 %, due 11/15/2025	163	0,09
220	Cigna Corp, 4,375 %, due 10/15/2028	246	0,13
210	Cimarex Energy Co, 3,900 %, due 5/15/2027	215	0,11
20	Cintas Corp Nr. 2, 2,900 %, due 4/1/2022	20	0,01
30	Cintas Corp Nr. 2, 3,700 %, due 4/1/2027	33	0,02
70	Citigroup Inc, 4,500 %, due 1/14/2022	74	0,04
80	Citigroup Inc, 3,500 %, due 5/15/2023	83	0,04
180	Citigroup Inc, 3,300 %, due 4/27/2025	191	0,10
60	Citigroup Inc, 4,400 %, due 6/10/2025	65	0,03
120	Citigroup Inc, 5,500 %, due 9/13/2025	138	0,07
60	Citigroup Inc, 4,300 %, due 11/20/2026	66	0,03
360	Citigroup Inc, 4,450 %, due 9/29/2027	396	0,21
370	Citigroup Inc, 8,125 %, due 7/15/2039	619	0,33
77	Citigroup Inc, 4,650 %, due 7/30/2045	96	0,05
10	Citigroup Inc, 4,750 %, due 5/18/2046	12	0,01
30	Citigroup Inc, 4,650 %, due 7/23/2048	38	0,02
20	Comcast Corp, 3,150 %, due 3/1/2026	21	0,01
320	Comcast Corp, 4,150 %, due 10/15/2028	363	0,19
100	Comcast Corp, 4,250 %, due 10/15/2030	116	0,06
121	Comcast Corp, 7,050 %, due 3/15/2033	176	0,09
140	Comcast Corp, 3,900 %, due 3/1/2038	157	0,08
30	Comcast Corp, 6,550 %, due 7/1/2039	44	0,02
120	Comcast Corp, 4,700 %, due 10/15/2048	151	0,08
30	Concho Resources Inc, 4,375 %, due 1/15/2025	31	0,02
100	Concho Resources Inc, 4,300 %, due 8/15/2028	109	0,06
20	ConocoPhillips Holding Co, 6,950 %, due 4/15/2029	28	0,01
340	Continental Resources Inc/OK, 3,800 %, due 6/1/2024	345	0,18
10	Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, due 1/15/2028	10	0,01
107	CVS Health Corp, 3,350 %, due 3/9/2021	109	0,06
50	CVS Health Corp, 2,750 %, due 12/1/2022	51	0,03
220	CVS Health Corp, 3,700 %, due 3/9/2023	230	0,12
160	CVS Health Corp, 4,100 %, due 3/25/2025	171	0,09
8	CVS Health Corp, 3,875 %, due 7/20/2025	9	–
497	CVS Health Corp, 4,300 %, due 3/25/2028	542	0,29
40	CVS Health Corp, 5,125 %, due 7/20/2045	47	0,02
60	CVS Health Corp, 5,050 %, due 3/25/2048	70	0,04
5	CVS Pass-Through Trust, 5,880 %, due 1/10/2028	6	–
29	Delta Air Lines 2007 - 1 Klasse A Pass Through Trust, Serie 071A, 6,821 %, due 8/10/2022	32	0,02
160	Devon Energy Corp, 5,850 %, due 12/15/2025	192	0,10
20	Devon Energy Corp, 5,600 %, due 7/15/2041	25	0,01
220	Devon Energy Corp, 5,000 %, due 6/15/2045	259	0,14
10	Duke Energy Corp, 3,550 %, due 9/15/2021	10	0,01
50	Duke Energy Corp, 2,400 %, due 8/15/2022	51	0,03
250	Duke Energy Corp, 3,150 %, due 8/15/2027	263	0,14
100	Duke Energy Corp, 3,950 %, due 8/15/2047	110	0,06
150	Eaton Corp., 2,750 %, due 11/2/2022	153	0,08
50	Eaton Corp., 4,150 %, due 11/2/2042	57	0,03
100	El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, due 6/15/2032	140	0,07
20	Eli Lilly & Co, 3,100 %, due 5/15/2027	21	0,01
120	Energy Transfer Operating LP, 4,500 %, due 4/15/2024	129	0,07
20	Energy Transfer Operating LP, 4,950 %, due 6/15/2028	22	0,01
50	Energy Transfer Operating LP, 5,250 %, due 4/15/2029	57	0,03
10	Energy Transfer Operating LP, 6,250 %, due 4/15/2049	12	0,01
10	Enterprise-Produkte Operating LLC, 4,150 %, due 10/16/2028	11	0,01
60	Enterprise-Produkte Operating LLC, 5,700 %, due 2/15/2042	76	0,04
20	EOG Resources Inc, 4,150 %, due 1/15/2026	22	0,01
140	Exxon Mobil Corp, 3,043 %, due 3/1/2026	149	0,08
130	Exxon Mobil Corp, 4,114 %, due 3/1/2046	158	0,08
70	Fifth Third Bancorp 3,650 %, due 1/25/2024	74	0,04
10	FirstEnergy Corp, Serie B, 4,250 %, due 3/15/2023	11	0,01
180	FirstEnergy Corp, Serie B, 3,900 %, due 7/15/2027	194	0,10
400	FirstEnergy Corp, Serie C, 7,375 %, due 11/15/2031	574	0,30
200	FirstEnergy Corp, Serie C, 4,850 %, due 7/15/2047	245	0,13
200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,200 %, due 1/15/2021	201	0,11
50	Fox Corp, 144A, 4,030 %, due 1/25/2024	54	0,03
80	Fox Corp, 144A, 4,709 %, due 1/25/2029	93	0,05
80	Fox Corp, 144A, 5,476 %, due 1/25/2039	100	0,05
30	Fox Corp, 144A, 5,576 %, due 1/25/2049	39	0,02
20	Freeport-McMoRan Inc, 3,550 %, due 3/1/2022	20	0,01
200	GE Capital International Finanzierung Co Unlimited Co, 2,342 %, due 11/15/2020	199	0,10

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
60	General Electric Co, 4,625 %, due 1/7/2021	61	0,03
50	General Electric Co, 5,300 %, due 2/11/2021	51	0,03
40	General Electric Co, 6,750 %, due 3/15/2032	49	0,03
110	General Electric Co, 5,875 %, due 1/14/2038	127	0,07
500	General Electric Co, 6,875 %, due 1/10/2039	638	0,34
30	General Electric Co, 4,500 %, due 3/11/2044	30	0,02
10	General Motors Co, 5,150 %, due 4/1/2038	10	0,01
30	General Motors Co, 6,250 %, due 10/2/2043	34	0,02
10	General Motors Co, 5,950 %, due 4/1/2049	11	0,01
20	General Motors Financial Co Inc, 2,450 %, due 11/6/2020	20	0,01
20	General Motors Financial Co Inc, 3,450 %, due 4/10/2022	20	0,01
120	General Motors Financial Co Inc, 4,350 %, due 1/17/2027	124	0,07
20	Gilead Sciences Inc, 1,850 %, due 9/20/2019	20	0,01
10	Gilead Sciences Inc, 2,550 %, due 9/1/2020	10	–
40	Gilead Sciences Inc, 3,700 %, due 4/1/2024	43	0,02
100	Gilead Sciences Inc, 3,650 %, due 3/1/2026	108	0,06
100	Gilead Sciences Inc, 4,750 %, due 3/1/2046	122	0,06
3	Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	3	–
280	Goldman Sachs Group Inc/Der, 2,876 %, due 10/31/2022 *	284	0,15
50	Goldman Sachs Group Inc/Der, 3,625 %, due 1/22/2023	52	0,03
70	Goldman Sachs Group Inc/Der, 3,200 %, due 2/23/2023	72	0,04
140	Goldman Sachs Group Inc/Der, 4,250 %, due 10/21/2025	151	0,08
90	Goldman Sachs Group Inc/Der, 3,500 %, due 11/16/2026	94	0,05
500	Goldman Sachs Group Inc/Der, 3,814 %, due 4/23/2029 *	538	0,28
580	Goldman Sachs Group Inc/Der, 4,223 %, due 5/1/2029 *	643	0,34
30	Goldman Sachs Group Inc/Der, 6,250 %, due 2/1/2041	43	0,02
130	Goldman Sachs Group Inc/Der, 5,150 %, due 5/22/2045	158	0,08
30	Goldman Sachs Group Inc/Der, 4,750 %, due 10/21/2045	37	0,02
150	Halliburton Co, 3,800 %, due 11/15/2025	159	0,08
30	Humana Inc, 3,150 %, due 12/1/2022	31	0,02
130	Humana Inc, 3,950 %, due 3/15/2027	139	0,07
10	Humana Inc, 4,950 %, due 10/1/2044	12	0,01
10	Intel Corp, 3,700 %, due 7/29/2025	11	0,01
310	International Business Machines Corp, 3,000 %, due 5/15/2024	323	0,17
80	International Lease Finance Corp., 8,625 %, due 1/15/2022	91	0,05
10	John Deere Capital Corp, 1,700 %, due 1/15/2020	10	–
130	Johnson & Johnson, 3,700 %, due 3/1/2046	151	0,08
110	JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, due 10/15/2020	113	0,06
10	JPMorgan Chase & Co, 4,350 %, due 8/15/2021	10	0,01
50	JPMorgan Chase & Co, 3,625 %, due 5/13/2024	54	0,03
230	JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, due 12/5/2024 *	247	0,13
170	JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, due 12/15/2026	187	0,10
420	JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, due 10/1/2027	469	0,25
170	JPMorgan Chase & Co, 3,625 %, due 12/1/2027	181	0,09
110	JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, due 7/23/2029 *	124	0,07
80	JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, due 12/5/2029 *	92	0,05
95	JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, due 6/1/2045	122	0,06
170	Kerr-Mc Gee Corp, 6,950 %, due 7/1/2024	201	0,11
20	Kinder Morgan Energy Partner LP, 3,500 %, due 3/1/2021	20	0,01
120	Kinder Morgan Inc/DE 4,300 %, due 3/1/2028	132	0,07
70	Kraft Heinz Foods Co, 3,950 %, due 7/15/2025	73	0,04
80	Kraft Heinz Foods Co, 3,000 %, due 6/1/2026	79	0,04
10	Kroger Co/The, 6,150 %, due 1/15/2020	10	0,01
120	L3Harris Technologies Inc, 4,854 %, due 4/27/2035	144	0,08
160	L3Harris Technologies Inc, 5,054 %, due 4/27/2045	204	0,11
260	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, due 8/8/2024	266	0,14
280	Lehman Brothers Escrow, zero coupon, Perpetual †∞ε	–	–
270	Lehman Brothers Holding Inc, zero coupon, Perpetual †∞ε	–	–
140	Lehman Brothers Holdings Capital Trust Escrow, zero coupon, Perpetual †∞ε	–	–
125	Lehman Escrow Receipt, zero coupon, Perpetual †∞	2	–
104	Lehman Swap Receipt, zero coupon, Perpetual †∞	1	–
20	Lockheed Martin Corp 3,100 %, due 1/15/2023	21	0,01
50	Lockheed Martin Corp 3,550 %, due 1/15/2026	54	0,03
100	Lockheed Martin Corp 4,500 %, due 5/15/2036	121	0,06
60	Mars Inc, 144A, 2,700 %, due 4/1/2025	62	0,03
260	Mars Inc, 144A, 3,200 %, due 4/1/2030	278	0,15
180	Mastercard Inc., 3,375 %, due 4/1/2024	192	0,10
30	McDonald's Corp, 3,700 %, due 1/30/2026	33	0,02
30	McDonald's Corp, 3,800 %, due 4/1/2028	33	0,02
180	McDonald's Corp, 4,875 %, due 12/9/2045	223	0,12
45	Medtronic Inc., 3,500 %, due 3/15/2025	49	0,03
15	Medtronic Inc., 4,625 %, due 3/15/2045	20	0,01
20	Merck & Co Inc 2,750 %, due 2/10/2025	21	0,01
215	MetLife Inc, 6,400 %, due 12/15/2036	251	0,13
70	Microsoft Corp, 1,550 %, due 8/8/2021	70	0,04
90	Microsoft Corp, 2,400 %, due 2/6/2022	92	0,05
300	Microsoft Corp, 2,400 %, due 8/8/2026	310	0,16
240	Microsoft Corp, 3,300 %, due 2/6/2027	262	0,14
60	Microsoft Corp, 3,750 %, due 2/12/2045	71	0,04
100	Microsoft Corp, 3,700 %, due 8/8/2046	118	0,06
140	MidAmerican Energy Co, 3,650 %, due 4/15/2029	157	0,08
450	Morgan Stanley, 3,772 %, due 1/24/2029 *	488	0,26
190	MPLX LP, 4,000 %, due 3/15/2028	199	0,10
150	MPLX LP, 4,500 %, due 4/15/2038	155	0,08
180	MPLX LP, 4,700 %, due 4/15/2048	186	0,10
20	NBCUniversal Media LLC, 5,950 %, due 4/1/2041	28	0,01
100	Newell Brands Inc, 4,200 %, due 4/1/2026	104	0,05
40	Noble Energy Inc, 4,150 %, due 12/15/2021	41	0,02
20	Noble Energy Inc, 3,850 %, due 1/15/2028	21	0,01
330	Noble Energy Inc, 4,950 %, due 8/15/2047	368	0,19
150	Northrop Grumman Corp. 2,550 %, due 10/15/2022	152	0,08
200	Northrop Grumman Corp. 2,930 %, due 1/15/2025	207	0,11
20	Northrop Grumman Corp. 3,250 %, due 1/15/2028	21	0,01
50	Occidental Petroleum Corp 2,600 %, due 8/13/2021	50	0,03
80	Occidental Petroleum Corp 2,700 %, due 8/15/2022	81	0,04
10	Occidental Petroleum Corp 2,700 %, due 2/15/2023	10	–
70	Occidental Petroleum Corp 2,900 %, due 8/15/2024	71	0,04
10	Occidental Petroleum Corp 3,400 %, due 4/15/2026	10	0,01
20	Occidental Petroleum Corp 3,000 %, due 2/15/2027	20	0,01
20	Occidental Petroleum Corp 3,500 %, due 8/15/2029	20	0,01
40	Occidental Petroleum Corp 4,625 %, due 6/15/2045	42	0,02
10	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, due 4/15/2046	10	0,01
110	Occidental Petroleum Corp 4,100 %, due 2/15/2047	109	0,06
150	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, due 3/15/2048	152	0,08
20	Philip Morris International Inc, 1,875 %, due 11/1/2019	20	0,01
20	Philip Morris International Inc, 2,900 %, due 11/15/2021	20	0,01
20	Philip Morris International Inc, 2,500 %, due 8/22/2022	20	0,01
230	Philip Morris International Inc, 2,500 %, due 11/2/2022	233	0,12
100	Philip Morris International Inc, 6,375 %, due 5/16/2038	137	0,07
10	Philip Morris International Inc, 4,500 %, due 3/20/2042	11	0,01
10	Progress Energy Inc, 3,150 %, due 4/1/2022	10	0,01
10	Raytheon Co, 3,125 %, due 10/15/2020	10	–
60	Republic Services Inc., 2,500 %, due 8/15/2024	61	0,03
50	salesforce.com Inc., 3,250 %, due 4/11/2023	52	0,03
250	salesforce.com Inc., 3,700 %, due 4/11/2028	279	0,15

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
100	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, due 3/1/2032	143	0,08
10	State Street Corp, 3,300 %, due 12/16/2024	11	0,01
2	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, due 12/16/2039	3	–
100	Texas Instruments Inc, 3,875 %, due 3/15/2039	118	0,06
80	Texas Instruments Inc, 4,150 %, due 5/15/2048	99	0,05
80	Time Warner Cable LLC, 4,125 %, due 2/15/2021	82	0,04
100	Time Warner Cable LLC, 5,875 %, due 11/15/2040	114	0,06
20	TJX Cos Inc/The 2,250 %, due 9/15/2026	20	0,01
400	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, due 2/1/2026	512	0,27
70	Union Pacific Corp, 3,750 %, due 7/15/2025	76	0,04
170	Union Pacific Corp, 3,950 %, due 9/10/2028	191	0,10
90	Union Pacific Corp, 4,500 %, due 9/10/2048	110	0,06
100	United Technologies Corp, 4,500 %, due 6/1/2042	121	0,06
40	UnitedHealth Group Inc, 2,700 %, due 7/15/2020	40	0,02
20	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, due 10/15/2020	20	0,01
30	UnitedHealth Group Inc, 2,875 %, due 12/15/2021	31	0,02
30	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, due 12/15/2028	34	0,02
50	UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, due 3/15/2043	58	0,03
50	UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, due 8/15/2049	55	0,03
50	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, due 8/15/2059	56	0,03
50	US Bancorp, 3,600 %, due 9/11/2024	54	0,03
250	US Bank NA/Cincinnati OH, 3,150 %, due 4/26/2021	255	0,13
100	Verizon Communications Inc, 3,376 %, due 2/15/2025	106	0,06
40	Verizon Communications Inc, 2,625 %, due 8/15/2026	41	0,02
40	Verizon Communications Inc, 4,125 %, due 3/16/2027	45	0,02
205	Verizon Communications Inc, 4,329 %, due 9/21/2028	235	0,12
30	Verizon Communications Inc, 3,875 %, due 2/8/2029	33	0,02
80	Verizon Communications Inc, 4,500 %, due 8/10/2033	94	0,05
60	Verizon Communications Inc, 4,400 %, due 11/1/2034	70	0,04
20	Verizon Communications Inc, 5,250 %, due 3/16/2037	25	0,01
180	Verizon Communications Inc, 3,850 %, due 11/1/2042	195	0,10
20	Verizon Communications Inc, 4,862 %, due 8/21/2046	25	0,01
40	Verizon Communications Inc, 4,522 %, due 9/15/2048	48	0,03
10	Viacom Inc., 4,250 %, due 9/1/2023	11	0,01
20	Visa Inc., 2,200 %, due 12/14/2020	20	0,01
180	Visa Inc., 3,150 %, due 12/14/2025	193	0,10
30	Visa Inc., 4,300 %, due 12/14/2045	38	0,02
150	Visa Inc., 3,650 %, due 9/15/2047	175	0,09
110	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual *	110	0,06
30	Walgreens Boots Alliance Inc, 3,450 %, due 6/1/2026	31	0,02
90	Walmart Inc, 3,050 %, due 7/8/2026	96	0,05
180	Walmart Inc, 3,700 %, due 6/26/2028	202	0,11
20	Walt Disney Co/The, 6,650 %, due 11/15/2037	30	0,02
10	Waste Management Inc, 4,600 %, due 3/1/2021	10	0,01
10	Waste Management Inc, 3,500 %, due 5/15/2024	11	0,01
30	Waste Management Inc, 3,200 %, due 6/15/2026	32	0,02
60	Waste Management Inc, 3,450 %, due 6/15/2029	66	0,03
40	Waste Management Inc, 4,000 %, due 7/15/2039	46	0,02
50	Waste Management Inc, 4,150 %, due 7/15/2049	60	0,03
60	Wells Fargo & Co, 4,125 %, due 8/15/2023	64	0,03
61	Wells Fargo & Co, 4,480 %, due 1/16/2024	66	0,03
40	Wells Fargo & Co, 3,750 %, due 1/24/2024	43	0,02
200	Wells Fargo & Co, 4,100 %, due 6/3/2026	217	0,11
180	Wells Fargo & Co, 3,000 %, due 10/23/2026	187	0,10
360	Wells Fargo & Co, 4,300 %, due 7/22/2027	399	0,21
150	Wells Fargo & Co, 4,150 %, due 1/24/2029	168	0,09
20	Wells Fargo & Co, 4,650 %, due 11/4/2044	24	0,01
50	Wells Fargo & Co, 4,900 %, due 11/17/2045	62	0,03
530	Wells Fargo & Co, 4,400 %, due 6/14/2046	616	0,32
150	Wells Fargo & Co, 4,750 %, due 12/7/2046	184	0,10
20	Williams Cos Inc/The, 5,250 %, due 3/15/2020	20	0,01
30	Wyeth LLC, 5,950 %, due 4/1/2037	42	0,02
		39.751	20,94
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 55.962)		60.458	31,85
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 17,26 % (28. Februar 2019: 11,70 %)			
China – 0,04 % (28. Februar 2019: 0,05 %)			
CNY 500	China Government Bond, 3,310 %, due 11/30/2025	72	0,04
Kolumbien – 0,78 % (28. Februar 2019: 0,67 %)			
200	Colombia Government Internationale Anleihe, 4,500 %, due 3/15/2029	228	0,12
600	Colombia Government Internationale Anleihe, 5,625 %, due 2/26/2044	774	0,40
390	Colombia Government Internationale Anleihe, 5,200 %, due 5/15/2049	490	0,26
		1.492	0,78
Indien – 0,11 % (28. Februar 2019: 0,12 %)			
200	Export-Import Bank of India, 3,375 %, due 8/5/2026	206	0,11
Indonesien – 0,78 % (28. Februar 2019: 0,68 %)			
200	Indonesia Government Internationale Anleihe, 4,625 %, due 4/15/2043	230	0,12
1.100	Indonesia Government Internationale Anleihe, 4,350 %, due 1/11/2048	1.253	0,66
		1.483	0,78
Kasachstan – 0,13 % (28. Februar 2019: 0,13 %)			
200	Kazakhstan Government Internationale Anleihe, 4,875 %, due 10/14/2044	244	0,13
Kuwait – 0,15 % (28. Februar 2019: 0,17 %)			
260	Kuwait International Staatsanleihe, 3,500 %, due 3/20/2027	286	0,15
Mexiko – 0,96 % (28. Februar 2019: 0,90 %)			
1.640	Regierung Mexikos Internationale Anleihe, 4,750 %, due 3/8/2044	1.816	0,96
Panama – 0,28 % (28. Februar 2019: 0,29 %)			
190	Panama Government Internationale Anleihe, 6,700 %, due 1/26/2036	279	0,15
200	Panama Government International Bond, 4,500 %, due 5/15/2047	248	0,13
		527	0,28
Peru – 0,44 % (28. Februar 2019: 0,34 %)			
180	Peruanische Regierung Internationale Anleihe, 6,550 %, due 3/14/2037	274	0,14
370	Peruanische Regierung Internationale Anleihe, 5,625 %, due 11/18/2050	565	0,30
		839	0,44
Polen – 0,30 % (28. Februar 2019: 0,36 %)			
130	Republik Polen Government International Bond, 5,000 %, due 3/23/2022	140	0,07
400	Republik Polen Government International Bond, 4,000 %, due 1/22/2024	436	0,23
		576	0,30
Katar – 0,39 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
570	Qatar Government International Bond, 144A, 4,817 %, due 3/14/2049	735	0,39
Russland – 0,52 % (28. Februar 2019: 0,56 %)			
600	Russian Foreign Bond – Eurobond, 5,625 %, due 4/4/2042	743	0,39
200	Russian Foreign Bond – Eurobond, 5,875 %, due 9/16/2043	256	0,13
		999	0,52
Saudi-Arabien – 0,22 % (28. Februar 2019: 0,25 %)			
400	Saudi Government Internationale Anleihe, 2,875 %, due 3/4/2023	412	0,22
Vereinigte Arabische Emirate – 0,24 % (28. Februar 2019: 0,29 %)			
450	Abu Dhabi Government Internationale Anleihe, 2,500 %, due 10/11/2022	458	0,24
USA – 11,49 % (28. Februar 2019: 6,43 %)			
520	Federal Home Loan Bank Rabatthinweise, zero coupon, due 9/20/2019	520	0,27
1.530	Federal Home Loan Bank Rabatthinweise, zero coupon, due 9/27/2019	1.528	0,81
250	Federal Home Loan Banks, 1,375 %, due 11/15/2019	250	0,13
40	Federal Home Loan Banks, 2,125 %, due 2/11/2020	40	0,02
360	Federal National Mortgage Association, zero coupon, due 10/9/2019	359	0,19
200	Tennessee Valley Authority, 3,875 %, due 2/15/2021	206	0,11
140	Tennessee Valley Authority, 1,875 %, due 8/15/2022	141	0,07
100	United States Treasury Inflationsindexierte Anleihen, 2,125 %, due 2/15/2040 β	163	0,09
20	United States Treasury Inflationsindexierte Anleihen, 0,750 %, due 2/15/2042 β	25	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
230	United States Treasury Inflationsindexierte Anleihen, 0,625 %, due 2/15/2043 β	273	0,14
700	United States Treasury Inflationsindexierte Anleihen, 1,375 %, due 2/15/2044 β	958	0,50
430	United States Treasury Inflationsindexierte Anleihen, 1,000 %, due 2/15/2046 β	540	0,28
1.430	United States Treasury Inflationsindexierte Anleihen, 1,000 %, due 2/15/2049 β	1.725	0,91
10	United States Treasury Note/ Bond, 2,125 %, due 5/15/2022	10	0,01
20	United States Treasury Note/ Bond, 2,250 %, due 4/30/2024	21	0,01
240	United States Treasury Note/ Bond, 1,750 %, due 6/30/2024	244	0,13
70	United States Treasury Note/ Bond, 2,250 %, due 3/31/2026	74	0,04
1.990	United States Treasury Note/ Bond, 2,125 %, due 5/31/2026	2.075	1,09
2.720	United States Treasury Note/ Bond, 1,875 %, due 6/30/2026	2.794	1,47
980	United States Treasury Note/ Bond, 2,375 %, due 5/15/2029	1.056	0,56
10	United States Treasury Note/ Bond, 1,625 %, due 8/15/2029	10	0,01
640	United States Treasury Note/ Bond, 3,750 %, due 11/15/2043	866	0,46
110	United States Treasury Note/ Bond, 2,875 %, due 8/15/2045	131	0,07
1.090	United States Treasury Note/ Bond, 2,750 %, due 11/15/2047	1.275	0,67
640	United States Treasury Note/ Bond, 3,000 %, due 2/15/2048	785	0,41
760	United States Treasury Note/ Bond, 3,125 %, due 5/15/2048	953	0,50
1.940	United States Treasury Note/ Bond, 3,000 %, due 8/15/2048	2.382	1,26
280	United States Treasury Note/ Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	345	0,18
1.710	United States Treasury Note/ Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	2.060	1,09
		21.809	11,49
Uruguay – 0,43 % (28. Februar 2019: 0,46 %)			
390	Uruguay Government Internationale Anleihe, 4,375 %, due 1/23/2031	443	0,23
300	Uruguay Government Internationale Anleihe, 5,100 %, due 6/18/2050	373	0,20
		816	0,43
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 28.850)		32.770	17,26

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Investmentfonds - 8,91 % (28. Februar 2019: 2,06 %)			
16.915	Western Asset Liquidity Funds PLC - Western Asset US-Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	16.915	8,91
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 16.915)		16.915	8,91
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 195.554)		205.853	108,44

Kontrakte (in Tsd.)	wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Gekaufte Optionen – 0,06 % (28. Februar 2019: 0,01 %)		
– IMM Euro$ Dezember 2019 Call 97,3750, due 12/16/2019	36	0,02
– IMM Euro$ Dezember 2019 Call 98,1250, due 12/16/2019	8	–
– U.S. 10 Year October 2019 Call 131,50, due 9/20/2019	33	0,02
– U.S. 10 Year October 2019 Call 132,00, due 9/20/2019	20	0,01
– U.S. 10 Year October 2019 Call 132,25, due 9/20/2019	17	0,01
– U.S. 10 Year October 2019 Put 131,25, due 9/20/2019	4	–
Gekaufte Optionen insgesamt (Anschaffungskosten USD 101)	118	0,06
Credit Default Swaps – 0,17 % (28. Februar 2019: 0,32 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	324	0,17
Zinsswaps – 0,42 % (28. Februar 2019: 0,23 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	799	0,42
Futures – 0,26 % (28. Februar 2019: 0,28 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	(493)	0,26
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	207.587	109,35
Verkaufte Optionen – (0,07 %) (28. Februar 2019: (0,02 %))		
– IMM Euro$ Dezember 2019 Call 97,6250, due 12/16/2019	(50)	(0,03)
– U.S. 10 Year October 2019 Call 128,50, due 9/20/2019	(32)	(0,02)
– U.S. 10 Year October 2019 Call 133,00, due 9/20/2019	(3)	–
– U.S. 10 Year October 2019 Call 133,50, due 9/20/2019	(10)	(0,01)
– U.S. 10 Year October 2019 Call 134,00, due 9/20/2019	(1)	–
– U.S. 10 Year October 2019 Put 128,00, due 9/20/2019	–	–
– U.S. 10 Year October 2019 Put 130,50, due 9/20/2019	(3)	–
– U.S. 5 Year October 2019 Call 121,00, due 9/20/2019	(2)	–
– U.S. 5 Year October 2019 Put 118,25, due 9/20/2019	–	–
– US-Bond Oktober 2019 Call 166,00, due 9/20/2019	(26)	(0,01)
– US-Bond Oktober 2019 Call 167,00, due 9/20/2019	(5)	–
Veräußerte Optionen gesamt (Anschaffungskosten USD (56))	(132)	(0,07)

Kontrakte (in Tsd.)	wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Zinsswaps – (1,89 %) (28. Februar 2019: 0,23 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(3.587)	(1,89)
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(9)	–
Futures – (0,02 %) (28. Februar 2019: 0,19 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(37)	(0,02)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	(3.765)	(1,98)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	203.822	107,37
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	(13.986)	(7,37)
Gesamtnettovermögen	USD 189.836	100,00

– Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 31. August 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 15.998.000 oder 8,45 % des Nettovermögens.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

† Illiquide.

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

ε Für das Wertpapier besteht am 31. August 2019 Zahlungsausfall.

± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

TBA – To Be Announced (wird angekündigt)

CNY – Chinesischer Renminbi

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	85,13
Investmentfonds	7,62
Derivate	0,78
Sonstige Vermögenswerte	6,47
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kauf/Verkauf Schutz	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 %	Verkauf	20.6.24	15.340	USD 324
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 502)					USD 324
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)					–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 502)					USD 324

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Ende der Laufzeit	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 2,250 %	26.4.22	8.978	USD 96
Goldman Sachs	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 1,850 %	15.6.22	4.550	54
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,300 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	26.4.23	9.146	(100)
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,250 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	31.12.25	2.108	(119)
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	31.1.26	8.732	(635)
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,550 %, Receive Floating USD Fed Funds Rate	30.4.26	5.582	(183)
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,850 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	30.4.26	12.378	(424)
Goldman Sachs	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 3,000 %	15.2.36	2.882	649
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,330 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.3.44	2.235	(843)
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,875 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.5.44	113	(32)
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,000 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.5.44	2.072	(642)
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,750 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.8.44	1.989	(515)
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,810 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.44	493	(29)
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,850 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.44	972	(65)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 358)				USD 799
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (361))				(3.587)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (3))				USD (2.788)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	387	Verkaufen	USD 435	USD (9)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)							–
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)							(9)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)							USD (9)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro$ December 2019	33	USD 8.096	USD 15
90 Day Euro$ June 2020	59	14.544	225
90 Day Euro$ March 2021	10	2.471	42
90 Day Euro$ September 2019	(174)	(42.603)	(19)
Fed Fund 30-Day November 2019	(70)	(28.670)	17
U.S. 10 Year Note (CBT) December 2019	(36)	(4.742)	(6)
U.S. 2 Year Note (CBT) December 2019	206	44.520	37
U.S. 5 Year Note (CBT) December 2019	(15)	(1.799)	–
U.S. Long Bond (CBT) December 2019	(36)	(5.949)	(12)
U.S. Ultra Bond (CBT) December 2019	70	13.821	157
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 440)			USD 493
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (300))			(37)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 140)			USD 456

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-invent-arwerts
Asset-Backed Securities - 3,96 % (28. Februar 2019: 3,83 %)			
275	Aegis Asset Backed Sec Corp Mort Pass Thr Certs Serie 2003-3, Serie 2003 3, Klasse M2, 4,620 %, due 1/25/2034 *	263	0,02
5.920	American Tower Trust #1 13, Klasse 2A, 144A, 3,070 %, due 3/15/2048	6.039	0,45
1.200	Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Ctfs Ser 2005-R7, Serie 2005 R7, Klasse M2, 2,645 %, due 9/25/2035 *	1.205	0,09
2.080	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Serie 2019 1A, Klasse A2I, 144A, 4,194 %, due 6/7/2049	2.140	0,16
8.222	Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Serie RFC 2007-HE1, Serie 2007 HE1, Klasse A4, 2,285 %, due 12/25/2036 *	7.996	0,59
2.390	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Serie 1996 1, Klasse B1, 7,875 %, due 10/10/2026	582	0,04
975	Community Funding CLO 2015-1A, Serie 2015 1A, Klasse A, 144A, 5,750 %, due 11/1/2027 †	1.034	0,08
37	ContiMortgage Home Equity Loan Trust 1999-1, Serie 1999 1, Klasse B, 9,000 %, due 4/25/2030	39	–
1.940	Countrywide Asset-Backed Certificates, Serie 2005 8, Klasse M4, 3,075 %, due 12/25/2035 *	1.955	0,15
97	Countrywide Home Equity Loan Trust, Serie 2006 HW, Klasse 2A1B, 2,345 %, due 11/15/2036 *	86	0,01
1.960	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse M2, 144A, 3,084 %, due 7/25/2057 *	1.778	0,13
244	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-13, Serie 2004 13, Klasse MF1, 5,071 %, due 4/25/2035 *	248	0,02
2.725	Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Serie 2018 2, Klasse A, 144A, 3,720 %, due 12/20/2038	2.763	0,20
2.672	Encore Credit Receivables Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse M5, 3,105 %, due 10/25/2035 *	2.613	0,19
299	Fannie Mae Grantor Trust 2017-T1, Serie 2017 T1, Klasse A, 2,898 %, due 6/25/2027	315	0,02
8.581	Fieldstone Mortgage Investment Trust Serie 2005-2, Serie 2005 2, Klasse M3, 2,925 %, due 12/25/2035 *	5.714	0,42
2.060	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Serie 2018 4, Klasse A, 4,060 %, due 11/15/2030	2.316	0,17
200	Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates FRESR 2017-SR01, Serie 2017 SR01, Klasse A3, 3,089 %, due 11/25/2027	211	0,02
1.184	Goal Capital Funding Trust, Serie 2005 2, Klasse A4, 2,332 %, due 8/25/2044 *	1.153	0,09
1.769	GSAMP Trust 2005-NC1, Serie 2005 NC1, Klasse M2, 3,240 %, due 2/25/2035 *	1.383	0,10
350	Hertz Vehicle Financing II LP, Serie 2015 1A, Klasse C, 144A, 4,350 %, due 3/25/2021	352	0,03
1.600	Hertz Vehicle Financing II LP, Serie 2017 1A, Klasse B, 144A, 3,560 %, due 10/25/2021	1.614	0,12
3.260	Nelnet Student Loan Trust 2007-1, Serie 2007 1, Klasse A4, 2,242 %, due 8/27/2036 *	3.089	0,23
1.715	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Klasse 1A1, 5,866 %, due 1/25/2037	1.686	0,13
761	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2006-A, Serie 2006 A, Klasse A2, 4,376 %, due 10/15/2037 *	731	0,05
2.708	Renaissance Home Equity Loan Trust 2004-1, Serie 2004 1, Klasse AV3, 3,085 %, due 5/25/2034 *	2.688	0,20
228	SBA Small Business Investment Cos, Serie 2018 10B, Klasse 1, 3,548 %, due 9/10/2028	245	0,02
23	SLM Student Loan EDC Repackaging Trust 2013-M1, Serie 2013 M1, Klasse M1, 144A, 3,500 %, due 10/28/2029	23	–
970	SMB Private Education Loan Trust 2014-A, Serie 2014 A, Klasse A3, 144A, 3,695 %, due 4/15/2032 *	983	0,07
2	SMB Private Education Loan Trust 2015-A, Serie 2015 A, Klasse R, 144A, 0,000 %, due 10/15/2048	1.338	0,10
872	Towd Point Mortgage Trust 2016-3, Serie 2016 3, Klasse A1, 144A, 2,250 %, due 4/25/2056 *	871	0,06
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 52.701)		53.453	3,96
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 37,81 % (28. Februar 2019: 41,87 %)			
103	Alternative Loan Trust 2005-14, Serie 2005 14, Klasse 2A2, 2,395 %, due 5/25/2035 *	92	0,01
340	Alternative Loan Trust 2005-56, Serie 2005 56, Klasse 4A1, 2,455 %, due 11/25/2035 *	339	0,03
242	Alternative Loan Trust 2005-IM1, Serie 2005 IM1, Klasse A1, 2,745 %, due 1/25/2036 *	237	0,02
61	Alternative Loan Trust 2006-18CB, Serie 2006 18CB, Klasse A6, 20,019 %, due 7/25/2036 *	104	0,01
353	APS Resecuritization Trust 2015-3, Serie 2015 3, Klasse 1A, 144A, 3,031 %, due 10/27/2046 *	357	0,03
2.286	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Klasse AJA, 144A, 6,006 %, due 8/10/2045 *	1.698	0,13
2.570	Banc of America Funding 2014-R2 Trust, Serie 2014 R2, Klasse 2A2, 144A, 2,355 %, due 5/26/2037 *	2.278	0,17
780	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Klasse A5, 3,435 %, due 9/15/2060	852	0,06
13.237	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Klasse XA, 0,933 %, due 9/15/2060 *	645	0,05
2.570	BBCCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Klasse E, 144A, 4,715 %, due 8/10/2033 *	2.430	0,18
576	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Klasse 1A1, 2,305 %, due 1/25/2037 *	564	0,04
577	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND, Serie 2018 IND, Klasse G, 144A, 4,245 %, due 11/15/2035 *	579	0,04
2.696	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND, Serie 2018 IND, Klasse H, 144A, 5,195 %, due 11/15/2035 *	2.708	0,20
3.100	BXP Trust 2017-CQHP, Serie 2017 CQHP, Klasse A, 144A, 3,045 %, due 11/15/2034 *	3.094	0,23
102	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse 1A2, 2,725 %, due 4/25/2035 *	100	0,01
300	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27, Serie 2015 GC27, Klasse AS, 3,571 %, due 2/10/2048	318	0,02
8.968	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Klasse 2A4, 2,365 %, due 9/25/2036 *	3.355	0,25
20	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Serie 2013 CR12, Klasse B, 4,762 %, due 10/10/2046 *	21	–
10	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Serie 2013 CR12, Klasse C, 5,231 %, due 10/10/2046 *	10	–
726	COMM 2013-CCRE6 Mortgage Trust, Serie 2013 CR6, Klasse B, 144A, 3,397 %, due 3/10/2046	749	0,06
90	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Klasse B, 4,035 %, due 2/10/2048 *	95	0,01
70	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Klasse C, 4,487 %, due 2/10/2048 *	73	0,01
20	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Serie 2006-C3, Serie 2006 C3, Klasse AJ, 6,702 %, due 6/15/2038 *	12	–
11	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Serie 2006-C5, Serie 2006 C5, Klasse AJ, 5,373 %, due 12/15/2039	8	–
500	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Serie 2015 C1, Klasse AS, 3,791 %, due 4/15/2050 *	538	0,04
1.050	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse A2, 144A, 3,953 %, due 9/15/2037	1.139	0,08
140	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse E, 144A, 4,373 %, due 9/15/2037	135	0,01
250	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse F, 144A, 4,373 %, due 9/15/2037	231	0,02

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-invent-arwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
125	CSMC Trust 2015-GLPA, Serie 2015 GLPA, Klasse A, 144A, 3,881 %, due 11/15/2037	139	0,01
600	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Klasse G, 144A, 7,815 %, due 7/15/2032 *	593	0,04
925	CSMC Trust 2018-PLUM, Serie 2018 PLUM, Klasse A 144A, 5,427 %, due 8/15/2020 *	926	0,07
1.680	DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, Serie 2017 BBG, Klasse A, 144A, 2,895 %, due 6/15/2034 *	1.678	0,12
520	DBUBS 2011-LC1 Mortgage Trust, Serie 2011 LC1A, Klasse C, 144A, 5,885 %, due 11/10/2046 *	539	0,04
253	Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Serie 2006-PR1, Serie 2006 PR1, Klasse 3AF1, 144A, 2,475 %, due 4/15/2036 *	238	0,02
998	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2014 C03, Klasse 1M2, 5,145 %, due 7/25/2024 *	1.048	0,08
1.420	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C04, Klasse 1M2, 6,395 %, due 1/25/2029 *	1.499	0,11
2.340	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1B1, 5,895 %, due 10/25/2030 *	2.450	0,18
560	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C05, Klasse 1B1, 6,395 %, due 1/25/2031 *	602	0,04
27	Fannie Mae Interest Strip 390, Klasse C3, 6,000 %, due 7/25/2038	5	–
14	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 22, 5,000 %, due 1/25/2039	2	–
7	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 23, 5,000 %, due 1/25/2039 *	1	–
15	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 27, 5,500 %, due 1/25/2039 *	2	–
11	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 34, 5,000 %, due 1/25/2038	2	–
34	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 41, 6,000 %, due 1/25/2038	6	–
160	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C13, 3,500 %, due 11/25/2041	21	–
168	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C18, 4,000 %, due 4/25/2042	22	–
246	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C2, 3,000 %, due 4/25/2027	17	–
148	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C22, 4,500 %, due 11/25/2039	25	–
14.300	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 3,500 % ±	14.821	1,10
2.000	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 2,500 % ±	2.027	0,15
7.800	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500 % ±	8.018	0,59
15.100	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000 % ±	15.678	1,16
7.900	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	8.318	0,62
1.800	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,000 % ±	1.922	0,14
3.300	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	3.320	0,25
12.400	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	12.646	0,94
20	Fannie Mae Pool ‘254793’, 5,000 %, due 7/1/2033	22	–
24	Fannie Mae Pool ‘555743’, 5,000 %, due 9/1/2033	27	–
2	Fannie Mae Pool ‘725162’, 6,000 %, due 2/1/2034	2	–
9	Fannie Mae Pool ‘745000’, 6,000 %, due 10/1/2035	10	–
16	Fannie Mae Pool ‘843997’, 4,458 %, due 11/1/2035 *	17	–
19	Fannie Mae Pool ‘865915’, 4,606 %, due 3/1/2036 *	19	–
28	Fannie Mae Pool ‘888560’, 6,000 %, due 11/1/2035	32	–
67	Fannie Mae Pool ‘889117’, 5,000 %, due 10/1/2035	74	0,01
58	Fannie Mae Pool ‘890248’, 6,000 %, due 8/1/2037	67	0,01
901	Fannie Mae Pool ‘890604’, 4,500 %, due 10/1/2044	981	0,07
95	Fannie Mae Pool ‘890876’, 3,500 %, due 2/1/2049	100	0,01
12	Fannie Mae Pool ‘985626’, 6,000 %, due 4/1/2033	14	–
31	Fannie Mae Pool ‘995072’, 5,500 %, due 8/1/2038	35	–
996	Fannie Mae Pool ‘AB6201’, 3,000 %, due 9/1/2042	1.032	0,08
84	Fannie Mae Pool ‘AB9683’, 4,000 %, due 6/1/2043	90	0,01
69	Fannie Mae Pool ‘AE0758’, 7,000 %, due 2/1/2039	82	0,01
76	Fannie Mae Pool ‘AK8441’, 4,000 %, due 4/1/2042	80	0,01
4	Fannie Mae Pool ‘AL2931’, 6,000 %, due 6/1/2023	4	–
920	Fannie Mae Pool ‘AL3024’, 3,500 %, due 1/1/2043	963	0,07
76	Fannie Mae Pool ‘AL3026’, 3,500 %, due 12/1/2042	80	0,01
50	Fannie Mae Pool ‘AL3508’, 4,000 %, due 4/1/2043	54	–
50	Fannie Mae Pool ‘AL4741’, 4,500 %, due 1/1/2044	54	–
156	Fannie Mae Pool ‘AL9397’, 3,000 %, due 10/1/2046	161	0,01
640	Fannie Mae Pool ‘AL9631’, 3,000 %, due 12/1/2046	662	0,05
10	Fannie Mae Pool ‘AM8674’, 2,810 %, due 4/1/2025	11	–
45	Fannie Mae Pool ‘AO2711’, 4,000 %, due 5/1/2042	49	–
32	Fannie Mae Pool ‘AO6086’, 4,000 %, due 6/1/2042	34	–
43	Fannie Mae Pool ‘AO9859’, 4,000 %, due 7/1/2042	46	–
27	Fannie Mae Pool ‘AP0692’, 4,000 %, due 7/1/2042	28	–
33	Fannie Mae Pool ‘AP2530’, 4,000 %, due 8/1/2042	35	–
31	Fannie Mae Pool ‘AP2958’, 4,000 %, due 8/1/2042	33	–
135	Fannie Mae Pool ‘AP4710’, 3,500 %, due 8/1/2042	141	0,01
457	Fannie Mae Pool ‘AP4781’, 3,000 %, due 9/1/2042	474	0,04
44	Fannie Mae Pool ‘AP4903’, 4,000 %, due 9/1/2042	48	–
125	Fannie Mae Pool ‘AP7399’, 4,000 %, due 9/1/2042	134	0,01
65	Fannie Mae Pool ‘AP9229’, 4,000 %, due 10/1/2042	70	0,01
173	Fannie Mae Pool ‘AP9766’, 4,000 %, due 10/1/2042	184	0,01
137	Fannie Mae Pool ‘AP9862’, 4,000 %, due 10/1/2042	146	0,01
58	Fannie Mae Pool ‘AQ0100’, 4,000 %, due 10/1/2042	62	–
222	Fannie Mae Pool ‘AQ1641’, 4,000 %, due 10/1/2042	238	0,02
27	Fannie Mae Pool ‘AQ3599’, 4,000 %, due 11/1/2042	28	–
48	Fannie Mae Pool ‘AQ4078’, 4,000 %, due 6/1/2043	52	–
43	Fannie Mae Pool ‘AQ4080’, 4,000 %, due 6/1/2043	46	–
72	Fannie Mae Pool ‘AQ4555’, 4,000 %, due 12/1/2042	77	0,01
29	Fannie Mae Pool ‘AQ5137’, 4,000 %, due 11/1/2042	31	–
90	Fannie Mae Pool ‘AQ7003’, 4,000 %, due 12/1/2042	97	0,01
147	Fannie Mae Pool ‘AQ7082’, 4,000 %, due 1/1/2043	157	0,01
1.332	Fannie Mae Pool ‘AS0066’, 2,500 %, due 8/1/2023	1.350	0,10
54	Fannie Mae Pool ‘AS0070’, 4,000 %, due 8/1/2043	57	–
52	Fannie Mae Pool ‘AS4271’, 4,500 %, due 1/1/2045	58	–
103	Fannie Mae Pool ‘AS4347’, 4,000 %, due 1/1/2045	110	0,01
1.749	Fannie Mae Pool ‘AS6328’, 3,500 %, due 12/1/2045	1.815	0,13
279	Fannie Mae Pool ‘AS6340’, 3,500 %, due 12/1/2045	292	0,02
208	Fannie Mae Pool ‘AS6541’, 3,500 %, due 1/1/2046	219	0,02
207	Fannie Mae Pool ‘AS6562’, 3,500 %, due 1/1/2046	217	0,02
1.096	Fannie Mae Pool ‘AS7738’, 3,000 %, due 8/1/2046	1.130	0,08
154	Fannie Mae Pool ‘AS7844’, 3,000 %, due 9/1/2046	159	0,01
547	Fannie Mae Pool ‘AS8056’, 3,000 %, due 10/1/2046	563	0,04
62	Fannie Mae Pool ‘AS8072’, 3,000 %, due 10/1/2046	64	0,01
4.469	Fannie Mae Pool ‘AS8269’, 3,000 %, due 11/1/2046	4.597	0,34
1.818	Fannie Mae Pool ‘AS8359’, 3,000 %, due 11/1/2046	1.868	0,14
400	Fannie Mae Pool ‘AS8623’, 3,000 %, due 1/1/2047	412	0,03
239	Fannie Mae Pool ‘AS8650’, 3,000 %, due 1/1/2047	245	0,02
1.536	Fannie Mae Pool ‘AS8745’, 3,000 %, due 2/1/2047	1.590	0,12
2.360	Fannie Mae Pool ‘AS9453’, 4,000 %, due 4/1/2047	2.497	0,19
81	Fannie Mae Pool ‘AS9588’, 4,000 %, due 5/1/2047	86	0,01
47	Fannie Mae Pool ‘AT7208’, 4,000 %, due 6/1/2043	51	–
47	Fannie Mae Pool ‘AT8394’, 4,000 %, due 6/1/2043	51	–
150	Fannie Mae Pool ‘AT9637’, 4,000 %, due 7/1/2043	160	0,01
102	Fannie Mae Pool ‘AT9653’, 4,000 %, due 7/1/2043	111	0,01
83	Fannie Mae Pool ‘AT9657’, 4,000 %, due 7/1/2043	88	0,01
50	Fannie Mae Pool ‘AU9537’, 4,500 %, due 10/1/2043	54	–
194	Fannie Mae Pool ‘AV0894’, 4,500 %, due 11/1/2043	206	0,02
628	Fannie Mae Pool ‘AW0318’, 4,500 %, due 2/1/2044	675	0,05
769	Fannie Mae Pool ‘BC0884’, 3,000 %, due 5/1/2046	794	0,06
76	Fannie Mae Pool ‘BC1509’, 3,000 %, due 8/1/2046	79	0,01
227	Fannie Mae Pool ‘BC2817’, 3,000 %, due 9/1/2046	234	0,02
1.273	Fannie Mae Pool ‘BD2455’, 3,000 %, due 1/1/2047	1.314	0,10
461	Fannie Mae Pool ‘BD8104’, 3,000 %, due 10/1/2046	478	0,04
1.542	Fannie Mae Pool ‘BF0104’, 4,000 %, due 2/1/2056	1.632	0,12
3.988	Fannie Mae Pool ‘BF0145’, 3,500 %, due 3/1/2057	4.168	0,31
73	Fannie Mae Pool ‘BF0148’, 4,500 %, due 4/1/2056	79	0,01
1.553	Fannie Mae Pool ‘BF0163’, 5,000 %, due 11/1/2046	1.674	0,12

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-invent-arwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
851	Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, due 1/1/2057	900	0,07
1.787	Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, due 6/1/2057	1.890	0,14
1.595	Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, due 9/1/2057	1.723	0,13
637	Fannie Mae Pool 'BH2623', 4,000 %, due 8/1/2047	667	0,05
13.239	Fannie Mae Pool 'BH4101', 3,500 %, due 10/1/2047	13.706	1,02
260	Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, due 12/1/2037	268	0,02
200	Fannie Mae Pool 'BL0405', 3,640 %, due 11/1/2028	225	0,02
490	Fannie Mae Pool 'BL1085', 3,820 %, due 1/1/2029	558	0,04
496	Fannie Mae Pool 'BL1151', 3,600 %, due 1/1/2029	555	0,04
900	Fannie Mae Pool 'BL1280', 3,660 %, due 2/1/2029	1.014	0,08
930	Fannie Mae Pool 'BL1367', 3,830 %, due 1/1/2029	1.056	0,08
2.320	Fannie Mae Pool 'BL1651', 3,525 %, due 2/1/2029	2.601	0,19
100	Fannie Mae Pool 'BL2225', 3,300 %, due 4/1/2029	110	0,01
400	Fannie Mae Pool 'BL2379', 3,090 %, due 5/1/2029	435	0,03
100	Fannie Mae Pool 'BL2431', 3,310 %, due 5/1/2031	111	0,01
289	Fannie Mae Pool 'BL2454', 3,160 %, due 5/1/2029	315	0,02
289	Fannie Mae Pool 'BL2456', 3,260 %, due 5/1/2029	316	0,02
200	Fannie Mae Pool 'BL2457', 3,260 %, due 5/1/2029	220	0,02
520	Fannie Mae Pool 'BL2465', 3,240 %, due 5/1/2029	568	0,04
100	Fannie Mae Pool 'BL3413', 2,870 %, due 7/1/2031	106	0,01
1.000	Fannie Mae Pool 'BL3619', 2,925 %, due 8/1/2031	1.068	0,08
800	Fannie Mae Pool 'BL3643', 2,915 %, due 8/1/2031	853	0,06
2.600	Fannie Mae Pool 'BL3644', 2,850 %, due 8/1/2031	2.752	0,20
510	Fannie Mae Pool 'BL3648', 2,850 %, due 8/1/2031	540	0,04
700	Fannie Mae Pool 'BL3677', 2,930 %, due 8/1/2031	747	0,06
500	Fannie Mae Pool 'BL3681', 2,860 %, due 8/1/2031	531	0,04
1.485	Fannie Mae Pool 'BM1565', 3,000 %, due 4/1/2047	1.536	0,11
286	Fannie Mae Pool 'BM3473', 3,500 %, due 11/1/2047	300	0,02
87	Fannie Mae Pool 'BM3799', 3,000 %, due 8/1/2047	90	0,01
720	Fannie Mae Pool 'BM3904', 5,000 %, due 5/1/2048	770	0,06
379	Fannie Mae Pool 'BM4579', 3,000 %, due 4/1/2047	392	0,03
95	Fannie Mae Pool 'BM4750', 3,500 %, due 2/1/2045	99	0,01
624	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, due 3/1/2043	655	0,05
917	Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, due 12/1/2046	959	0,07
2.684	Fannie Mae Pool 'BM5521', 3,500 %, due 7/1/2048	2.793	0,21
4.073	Fannie Mae Pool 'BM5526', 3,500 %, due 2/1/2048	4.219	0,31
880	Fannie Mae Pool 'BN5424', 3,500 %, due 4/1/2049	909	0,07
4.390	Fannie Mae Pool 'BN7652', 3,000 %, due 7/1/2049	4.532	0,34
496	Fannie Mae Pool 'BN9558', 3,000 %, due 7/1/2049	506	0,04
196	Fannie Mae Pool 'BO0955', 3,500 %, due 6/1/2049	202	0,02
200	Fannie Mae Pool 'BO1858', 3,000 %, due 8/1/2049	207	0,02
400	Fannie Mae Pool 'BO3074', 3,000 %, due 8/1/2049	408	0,03
1.200	Fannie Mae Pool 'BO3815', 3,000 %, due 8/1/2049	1.224	0,09
1.158	Fannie Mae Pool 'CA0858', 3,500 %, due 12/1/2047	1.201	0,09
61	Fannie Mae Pool 'CA1050', 3,000 %, due 1/1/2048	63	–
2.254	Fannie Mae Pool 'CA2652', 5,000 %, due 11/1/2048	2.414	0,18
688	Fannie Mae Pool 'CA3471', 3,500 %, due 5/1/2049	716	0,05
595	Fannie Mae Pool 'CA3478', 3,500 %, due 5/1/2049	614	0,05
895	Fannie Mae Pool 'CA3634', 3,500 %, due 6/1/2049	935	0,07
792	Fannie Mae Pool 'CA3637', 3,500 %, due 6/1/2049	818	0,06
100	Fannie Mae Pool 'CA3809', 3,000 %, due 7/1/2049	103	0,01
988	Fannie Mae Pool 'CA3876', 3,500 %, due 7/1/2049	1.016	0,08
2.398	Fannie Mae Pool 'CA4017', 3,000 %, due 8/1/2049	2.452	0,18
700	Fannie Mae Pool 'CA4078', 3,000 %, due 9/1/2049	714	0,05
3.800	Fannie Mae Pool 'CA4110', 3,000 %, due 9/1/2049	3.918	0,29
4.000	Fannie Mae Pool 'CA4121', 3,000 %, due 9/1/2049	4.112	0,30
600	Fannie Mae Pool 'FM1341', 3,000 %, due 8/1/2049	614	0,05
28	Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, due 4/1/2031	30	–
107	Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, due 5/1/2031	115	0,01
30	Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, due 6/1/2031	33	–
45	Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, due 11/1/2031	48	–
52	Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, due 12/1/2031	56	–
220	Fannie Mae Pool 'MA1146', 4,000 %, due 8/1/2042	234	0,02
48	Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, due 9/1/2042	50	–
1.498	Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000 %, due 10/1/2042	1.596	0,12
320	Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000 %, due 11/1/2042	340	0,03
783	Fannie Mae Pool 'MA1283', 3,500 %, due 12/1/2042	820	0,06
546	Fannie Mae Pool 'MA1437', 3,500 %, due 5/1/2043	572	0,04
57	Fannie Mae Pool 'MA1547', 4,000 %, due 8/1/2043	61	–
107	Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, due 9/1/2043	115	0,01
110	Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, due 10/1/2043	118	0,01
57	Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, due 11/1/2043	61	–
106	Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, due 12/1/2043	114	0,01
551	Fannie Mae Pool 'MA2806', 3,000 %, due 11/1/2046	568	0,04
2.163	Fannie Mae Pool 'MA3383', 3,500 %, due 6/1/2048	2.236	0,17
2.045	Fannie Mae Pool 'MA3501', 5,000 %, due 10/1/2048	2.185	0,16
3.259	Fannie Mae Pool 'MA3665', 4,500 %, due 5/1/2049	3.436	0,25
9.900	Fannie Mae Pool 'MA3686', 3,500 %, due 6/1/2049	10.191	0,76
126	Fannie Mae REMICS, Serie 2005 29, Klasse ZA, 5,500 %, due 4/25/2035	146	0,01
633	Fannie Mae REMICS, Serie 2011 59, Klasse NZ, 5,500 %, due 7/25/2041	725	0,05
201	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 133, Klasse CS, 4,005 %, due 12/25/2042 *	36	–
41	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 28, Klasse B, 6,500 %, due 6/25/2039	44	–
375	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 35, Klasse SC, 4,355 %, due 4/25/2042 *	60	–
92	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 46, Klasse BA, 6,000 %, due 5/25/2042	103	0,01
132	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 51, Klasse B, 7,000 %, due 5/25/2042	160	0,01
21	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 70, Klasse YS, 4,505 %, due 2/25/2041 *	2	–
121	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 74, Klasse SA, 4,505 %, due 3/25/2042 *	17	–
334	Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, due 7/25/2042	395	0,03
427	Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, due 4/25/2042	485	0,04
2.281	Fannie Mae REMICS, Serie 2016 23, Klasse ST, 3,855 %, due 11/25/2045 *	494	0,04
868	Fannie Mae REMICS, Serie 2016 60, Klasse QS, 3,955 %, due 9/25/2046 *	147	0,01
381	Fannie Mae REMICS, Serie 2016 61, Klasse BS, 3,955 %, due 9/25/2046 *	66	0,01
1.890	Fannie Mae REMICS, Serie 2017 76, Klasse SB, 3,955 %, due 10/25/2057 *	382	0,03
500	Fannie Mae REMICS, Serie 2017 85, Klasse SC, 4,055 %, due 11/25/2047 *	86	0,01
2.100	Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ∞±	2.164	0,16
2.900	Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ∞±	2.976	0,22
8.577	Fannie Mae-Aces, Serie 2015 M3, Klasse X2, 0,461 %, due 10/25/2024 *	135	0,01
3.263	Flagstar Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Klasse A4, 144A, 3,500 %, due 4/25/2048 *	3.319	0,25
263	Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000 %, due 2/1/2038	269	0,02
268	Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, due 4/1/2038	275	0,02
7	Freddie Mac Gold Pool 'G01737', 5,000 %, due 12/1/2034	8	–
12	Freddie Mac Gold Pool 'G04222', 5,500 %, due 4/1/2038	14	–
260	Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000 %, due 11/1/2039	299	0,02
289	Freddie Mac Gold Pool 'G06496', 5,000 %, due 6/1/2041	318	0,02
30	Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, due 9/1/2039	36	–
113	Freddie Mac Gold Pool 'G06875', 5,500 %, due 12/1/2038	128	0,01
1.199	Freddie Mac Gold Pool 'G08682', 4,000 %, due 12/1/2045	1.266	0,09
737	Freddie Mac Gold Pool 'G08747', 3,000 %, due 2/1/2047	758	0,06
187	Freddie Mac Gold Pool 'G08778', 3,000 %, due 9/1/2047	192	0,01
83	Freddie Mac Gold Pool 'G08793', 4,000 %, due 12/1/2047	87	0,01
667	Freddie Mac Gold Pool 'G08829', 3,000 %, due 7/1/2048	683	0,05

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-invent-arwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
3.027	Freddie Mac Gold Pool ‘G08851’, 3,500 %, due 12/1/2048	3.123	0,23
29	Freddie Mac Gold Pool ‘G13888’, 5,000 %, due 6/1/2025	30	–
53	Freddie Mac Gold Pool ‘G14492’, 4,000 %, due 10/1/2025	55	–
83	Freddie Mac Gold Pool ‘G30257’, 5,000 %, due 7/1/2025	88	0,01
2.647	Freddie Mac Gold Pool ‘G60985’, 3,000 %, due 5/1/2047	2.738	0,20
452	Freddie Mac Gold Pool ‘G61587’, 3,000 %, due 4/1/2047	465	0,03
1.704	Freddie Mac Gold Pool ‘G61637’, 3,000 %, due 9/1/2047	1.760	0,13
1.691	Freddie Mac Gold Pool ‘G61739’, 3,000 %, due 9/1/2048	1.751	0,13
1.739	Freddie Mac Gold Pool ‘G67701’, 3,000 %, due 10/1/2046	1.800	0,13
50	Freddie Mac Gold Pool ‘Q19135’, 4,000 %, due 6/1/2043	54	–
46	Freddie Mac Gold Pool ‘Q19254’, 4,000 %, due 6/1/2043	50	–
48	Freddie Mac Gold Pool ‘Q19611’, 4,000 %, due 7/1/2043	53	–
49	Freddie Mac Gold Pool ‘Q19615’, 4,000 %, due 7/1/2043	53	–
25	Freddie Mac Gold Pool ‘Q27298’, 4,000 %, due 7/1/2044	26	–
802	Freddie Mac Gold Pool ‘Q40356’, 4,000 %, due 5/1/2046	846	0,06
626	Freddie Mac Gold Pool ‘Q43128’, 4,500 %, due 9/1/2046	667	0,05
653	Freddie Mac Gold Pool ‘Q45560’, 3,000 %, due 1/1/2047	675	0,05
1.584	Freddie Mac Gold Pool ‘Q45737’, 3,000 %, due 1/1/2047	1.640	0,12
405	Freddie Mac Gold Pool ‘Q45819’, 3,000 %, due 1/1/2047	419	0,03
328	Freddie Mac Gold Pool ‘Q45827’, 3,000 %, due 1/1/2047	339	0,03
444	Freddie Mac Gold Pool ‘Q47434’, 4,500 %, due 4/1/2047	470	0,04
1.320	Freddie Mac Gold Pool ‘Q48149’, 4,500 %, due 5/1/2047	1.403	0,10
173	Freddie Mac Gold Pool ‘Q48359’, 4,500 %, due 5/1/2047	183	0,01
25	Freddie Mac Gold Pool ‘Q48929’, 4,500 %, due 5/1/2047	26	–
666	Freddie Mac Gold Pool ‘Q49487’, 5,000 %, due 7/1/2047	714	0,05
24	Freddie Mac Gold Pool ‘Q49871’, 4,500 %, due 8/1/2047	25	–
88	Freddie Mac Gold Pool ‘Q55429’, 4,000 %, due 4/1/2048	92	0,01
705	Freddie Mac Gold Pool ‘Q55997’, 4,000 %, due 5/1/2048	737	0,05
13.571	Freddie Mac Gold Pool ‘Q57142’, 4,000 %, due 7/1/2048	14.161	1,05
728	Freddie Mac Gold Pool ‘Q57925’, 5,000 %, due 8/1/2048	779	0,06
2.841	Freddie Mac Gold Pool ‘Q62573’, 3,500 %, due 12/1/2048	2.938	0,22
108	Freddie Mac Gold Pool ‘U90245’, 3,500 %, due 10/1/2042	113	0,01
229	Freddie Mac Gold Pool ‘U90316’, 4,000 %, due 10/1/2042	244	0,02
108	Freddie Mac Gold Pool ‘U91254’, 4,000 %, due 4/1/2043	115	0,01
53	Freddie Mac Gold Pool ‘U95137’, 4,000 %, due 8/1/2043	56	–
622	Freddie Mac Gold Pool ‘U99045’, 3,500 %, due 3/1/2043	652	0,05
1.578	Freddie Mac Gold Pool ‘U99054’, 4,000 %, due 6/1/2043	1.683	0,12
58	Freddie Mac Gold Pool ‘U99114’, 3,500 %, due 2/1/2044	61	–
933	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K007, Klasse X1, 1,202 %, due 4/25/2020 *	3	–
448	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K015, Klasse X1, 1,726 %, due 7/25/2021 *	11	–
173	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K016, Klasse X1, 1,635 %, due 10/25/2021 *	5	–
13.545	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K058, Klasse X1, 1,056 %, due 8/25/2026 *	758	0,06
595	Freddie Mac Pool 'QA0794', 3,000 %, due 7/1/2049	606	0,05
10.548	Freddie Mac Pool 'QA1033', 3,000 %, due 7/1/2049	10.760	0,80
1.600	Freddie Mac Pool 'QA1597', 3,000 %, due 8/1/2049	1.632	0,12
400	Freddie Mac Pool 'QA1627', 3,000 %, due 8/1/2049	409	0,03
400	Freddie Mac Pool 'QA2090', 3,000 %, due 8/1/2049	410	0,03
1.088	Freddie Mac Pool ‘RA1103’, 3,000 %, due 7/1/2049	1.120	0,08
5.387	Freddie Mac Pool ‘RA1224’, 3,000 %, due 8/1/2049	5.505	0,41
1.400	Freddie Mac Pool ‘RA1293’, 3,000 %, due 9/1/2049	1.449	0,11
1.200	Freddie Mac Pool ‘RA1343’, 3,000 %, due 9/1/2049	1.234	0,09
7.900	Freddie Mac Pool ‘SD7504’, 3,500 %, due 8/1/2049	8.214	0,61
902	Freddie Mac Pool ‘ZA5233’, 3,000 %, due 1/1/2048	924	0,07
587	Freddie Mac Pool ‘ZA6498’, 3,500 %, due 3/1/2049	610	0,05
229	Freddie Mac Pool ‘ZI7269’, 5,000 %, due 3/1/2038	254	0,02
494	Freddie Mac Pool ‘ZM1278’, 3,500 %, due 6/1/2046	518	0,04
405	Freddie Mac Pool ‘ZM3481’, 3,500 %, due 6/1/2047	423	0,03
99	Freddie Mac Pool ‘ZM5722’, 3,500 %, due 2/1/2048	102	0,01
2.627	Freddie Mac Pool 'ZM7235', 4,000 %, due 7/1/2048	2.741	0,20
423	Freddie Mac Pool 'ZM8774', 5,000 %, due 10/1/2048	453	0,03
396	Freddie Mac Pool ‘ZN1436’, 5,000 %, due 11/1/2048	423	0,03
686	Freddie Mac Pool ‘ZN4119’, 3,000 %, due 3/1/2049	700	0,05
1.415	Freddie Mac Pool ‘ZN4121’, 3,500 %, due 3/1/2049	1.459	0,11
42	Freddie Mac Pool ‘ZS3059’, 5,500 %, due 12/1/2038	47	–
2.127	Freddie Mac Pool ‘ZS4727’, 4,000 %, due 7/1/2047	2.232	0,17
2.187	Freddie Mac Pool ‘ZS4735’, 3,500 %, due 9/1/2047	2.265	0,17
1.744	Freddie Mac Pool ‘ZS4755’, 3,500 %, due 2/1/2048	1.805	0,13
1.306	Freddie Mac Pool ‘ZS4790’, 4,000 %, due 9/1/2048	1.356	0,10
7.824	Freddie Mac Pool ‘ZT0712’, 4,000 %, due 10/1/2048	8.124	0,60
158	Freddie Mac Pool ‘ZT0714’, 5,000 %, due 10/1/2048	169	0,01
2.573	Freddie Mac Pool ‘ZT1481’, 4,000 %, due 11/1/2048	2.683	0,20
3.326	Freddie Mac Pool ‘ZT1545’, 4,000 %, due 12/1/2048	3.457	0,26
6.669	Freddie Mac Pool ‘ZT1593’, 3,500 %, due 1/1/2049	6.876	0,51
2.001	Freddie Mac Pool ‘ZT1596’, 5,000 %, due 1/1/2049	2.136	0,16
5.693	Freddie Mac Pool ‘ZT1776’, 3,500 %, due 3/1/2049	5.863	0,43
118	Freddie Mac Reference REMIC R007, Klasse ZA, 6,000 %, due 5/15/2036	138	0,01
78	Freddie Mac REMICS 3621, Klasse SB, 4,035 %, due 1/15/2040 *	13	–
1.924	Freddie Mac REMICS 4813, Klasse CJ, 3,000 %, due 8/15/2048	1.929	0,14
110	Freddie Mac Strips 334, Klasse S7, 3,905 %, due 8/15/2044 *	21	–
748	Freddie Mac Strips 353, Klasse S1, 3,805 %, due 12/15/2046 *	131	0,01
1.339	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2015 HQ2, Klasse B, 10,095 %, due 5/25/2025 *	1.623	0,12
400	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA2, Klasse M3, 6,795 %, due 10/25/2028 *	426	0,03
774	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 HQA1, Klasse M2, 4,895 %, due 9/25/2028 *	778	0,06
1.500	Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ∞±	1.533	0,11
2.700	Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ∞±	2.769	0,21
2.300	Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ∞±	2.351	0,17
4.293	FREMF 2012-K20 Mortgage Trust, Serie 2012 K20, Klasse X2A, 144A, 0,200 %, due 5/25/2045	19	–
2.220	GE Commercial Mortgage Corp Serie 2007-C1 Trust, Serie 2007 C1, Klasse AJ, 5,677 %, due 12/10/2049 *	527	0,04
80	Ginnie Mae I Pool ‘733600’, 5,000 %, due 4/15/2040	87	0,01
125	Ginnie Mae I Pool ‘733627’, 5,000 %, due 5/15/2040	140	0,01
1.044	Ginnie Mae I Pool ‘784571’, 3,500 %, due 6/15/2048	1.100	0,08

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-invent-arwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
169	Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, due 9/15/2042	175	0,01
496	Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, due 9/15/2042	514	0,04
953	Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, due 10/15/2042	987	0,07
625	Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, due 10/15/2042	647	0,05
1.765	Ginnie Mae I Pool 'AB9205', 3,000 %, due 11/15/2042	1.827	0,14
548	Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, due 11/15/2042	568	0,04
34	Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, due 10/20/2037	40	–
57	Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500 %, due 1/20/2040	61	–
67	Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500 %, due 5/20/2040	73	0,01
214	Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000 %, due 7/20/2040	236	0,02
38	Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000 %, due 8/20/2040	42	–
26	Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000 %, due 9/20/2040	29	–
13	Ginnie Mae II Pool '4871', 6,000 %, due 11/20/2040	15	–
49	Ginnie Mae II Pool '4905', 6,000 %, due 12/20/2040	56	–
9	Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000 %, due 1/20/2041	10	–
47	Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, due 2/20/2041	54	–
462	Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, due 3/20/2041	500	0,04
12	Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, due 7/20/2040	13	–
135	Ginnie Mae II Pool '783368', 4,500 %, due 7/20/2041	146	0,01
2.759	Ginnie Mae II Pool '784674', 3,500 %, due 4/20/2048	2.906	0,22
2.671	Ginnie Mae II Pool 'AP6338', 4,000 %, due 10/20/2045	2.846	0,21
699	Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, due 10/20/2047	730	0,05
508	Ginnie Mae II Pool 'BD0384', 3,500 %, due 10/20/2047	533	0,04
155	Ginnie Mae II Pool 'BJ1835', 4,500 %, due 9/20/2048	160	0,01
235	Ginnie Mae II Pool 'BJ1853', 4,500 %, due 9/20/2048	243	0,02
509	Ginnie Mae II Pool 'MA 1995', 3,500 %, due 6/20/2044	537	0,04
151	Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, due 3/20/2045	158	0,01
319	Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500 %, due 9/20/2046	333	0,02
2.255	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, due 6/20/2047	2.367	0,18
68	Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000 %, due 11/20/2047	71	0,01
84	Ginnie Mae II Pool 'MA4837', 3,500 %, due 11/20/2047	88	0,01
2.966	Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, due 11/20/2047	3.108	0,23
704	Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, due 12/20/2047	727	0,05
1.315	Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, due 12/20/2047	1.379	0,10
2.421	Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, due 2/20/2048	2.523	0,19
1.270	Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, due 2/20/2048	1.329	0,10
1.038	Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, due 3/20/2048	1.084	0,08
1.532	Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, due 4/20/2048	1.600	0,12
943	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, due 6/20/2048	991	0,07
2.580	Ginnie Mae II Pool 'MA5330', 4,000 %, due 7/20/2048	2.695	0,20
1.134	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, due 7/20/2048	1.190	0,09
1.878	Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, due 9/20/2048	1.968	0,15
1.873	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, due 1/20/2049	1.962	0,15
4.463	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000 %, due 1/20/2049	4.695	0,35
869	Ginnie Mae II Pool 'MA5762', 3,500 %, due 2/20/2049	903	0,07
292	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, due 3/20/2049	306	0,02
893	Ginnie Mae II Pool 'MA5931', 4,000 %, due 5/20/2049	933	0,07
3.600	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ±	3.707	0,27
8.200	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ±	8.455	0,63
25.600	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 % ±	26.602	1,97
2.500	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,000 % ±	2.606	0,19
3.100	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,500 % ±	3.244	0,24
706	Government National Mortgage Association, Serie 2009 H01, Klasse FA, 3,322 %, due 11/20/2059 *	712	0,05
13	Government National Mortgage Association, Serie 2010 31, Klasse GS, 4,328 %, due 3/20/2039 *	–	–
11	Government National Mortgage Association, Serie 2010 42, Klasse BS, 4,308 %, due 4/20/2040 *	2	–
17	Government National Mortgage Association, Serie 2010 85, Klasse HS, 4,478 %, due 1/20/2040 *	1	–
520	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H11, Klasse FA, 3,241 %, due 6/20/2060 *	528	0,04
575	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H20, Klasse AF, 2,710 %, due 10/20/2060 *	573	0,04
28	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H22, Klasse FE, 2,730 %, due 5/20/2059 *	28	–
965	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H24, Klasse FA, 2,730 %, due 10/20/2060 *	962	0,07
44	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H26, Klasse LF, 2,730 %, due 8/20/2058 *	44	–
353	Government National Mortgage Association, Serie 2011 H01, Klasse AF, 2,830 %, due 11/20/2060 *	353	0,03
102	Government National Mortgage Association, Serie 2011 H09, Klasse AF, 2,880 %, due 3/20/2061 *	102	0,01
118	Government National Mortgage Association, Serie 2012 66, Klasse CI, 3,500 %, due 2/20/2038	5	–
2.033	Government National Mortgage Association, Serie 2014 169, Klasse IO, 0,823 %, due 10/16/2056 *	97	0,01
620	Government National Mortgage Association, Serie 2014 176, Klasse IA, 4,000 %, due 11/20/2044	84	0,01
3.277	Government National Mortgage Association, Serie 2014 H20, Klasse FA, 2,810 %, due 10/20/2064 *	3.273	0,24
1.181	Government National Mortgage Association, Serie 2015 167, Klasse OI, 4,000 %, due 4/16/2045	180	0,01
3.416	Government National Mortgage Association, Serie 2015 183, Klasse IO, 0,934 %, due 9/16/2057 *	224	0,02
318	Government National Mortgage Association, Serie 2016 135, Klasse SB, 3,903 %, due 10/16/2046 *	72	0,01
1.680	Government National Mortgage Association, Serie 2016 21, Klasse ST, 3,978 %, due 2/20/2046 *	295	0,02
904	Government National Mortgage Association, Serie 2016 84, Klasse IG, 4,500 %, due 11/16/2045	143	0,01
2.893	Government National Mortgage Association, Serie 2017 111, Klasse IO, 0,740 %, due 2/16/2059 *	193	0,01
1.910	Government National Mortgage Association, Serie 2017 41, Klasse IO, 0,792 %, due 7/16/2058 *	125	0,01
193	Government National Mortgage Association, Serie 2017 H15, Klasse KI, 2,350 %, due 7/20/2067 *	27	–
7.707	Government National Mortgage Association, Serie 2017 H18, Klasse BI, 1,566 %, due 9/20/2067 *	776	0,06
98	Government National Mortgage Association, Serie 2017 H20, Klasse IB, 2,000 %, due 10/20/2067 *	11	–
2.970	Government National Mortgage Association, Serie 2018 119, Klasse IO, 0,653 %, due 5/16/2060 *	202	0,02
775	Government National Mortgage Association, Serie 2018 H06, Klasse PF, 2,680 %, due 2/20/2068 *	772	0,06
1.321	Government National Mortgage Association, Serie 2018 H07, Klasse FD, 2,680 %, due 5/20/2068 *	1.315	0,10
998	Government National Mortgage Association, Serie 2019 90, Klasse AB, 3,000 %, due 7/20/2049	1.016	0,08
3.180	GS Mortgage Securities Corp II, Serie 2018 SRP5, Klasse A, 144A, 3,495 %, due 9/15/2031 *	3.146	0,23
2.410	GS Mortgage Securities Corp II, Serie 2018 SRP5, Klasse B, 144A, 4,695 %, due 9/15/2031 *	2.384	0,18

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
300	GS Mortgage Securities Trust 2006-GG8, Serie 2006 GG8, Klasse AJ, 5,622 %, due 11/10/2039	265	0,02
80	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16, Serie 2013 GC16, Klasse B, 5,161 %, due 11/10/2046 *	89	0,01
1.245	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20, Serie 2014 GC20, Klasse XA, 1,227 %, due 4/10/2047 *	42	–
30	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-7, Serie 2007 7, Klasse 2A1A, 3,145 %, due 10/25/2037 *	31	–
868	Impac Secured Assets Trust 2006-4, Serie 2006 4, Klasse A2B, 2,315 %, due 1/25/2037 *	861	0,06
1.400	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP10, Serie 2007 LDPX, Klasse AJFX, 144A, 5,438 %, due 1/15/2049	277	0,02
2.001	JP Morgan Mortgage Trust 2017-5, Serie 2017 5, Klasse A2, 144A, 3,184 %, due 10/26/2048 *	2.059	0,15
1.606	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Klasse A1, 144A, 3,500 %, due 10/25/2048 *	1.637	0,12
30	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, Serie 2013 C17, Klasse B, 5,054 %, due 1/15/2047 *	33	–
160	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C31, Serie 2015 C31, Klasse B, 4,770 %, due 8/15/2048 *	178	0,01
1.290	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Serie 2019 BOLT, Klasse B, 144A, 4,395 %, due 7/15/2034 *	1.293	0,10
GBP 843	Magnolia Finance X Ltd, Serie 2015 3GNA, Klasse A1, 144A, 3,303 %, due 3/12/2020 *†	995	0,07
GBP 307	Magnolia Finance X Ltd, Serie 2015 3GNA, Klasse A2, 144A, 4,573 %, due 3/12/2020 *†	362	0,03
103	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2007-3, Serie 2007 3, Klasse 12A1, 2,345 %, due 5/25/2047 *	113	0,01
182	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJ, 5,450 %, due 8/12/2048 *	116	0,01
187	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-9, Serie 2007 9, Klasse AJ, 6,193 %, due 9/12/2049 *	81	0,01
54	Morgan Stanley Capital I Trust 2006-IQ12, Serie 2006 IQ12, Klasse AJ, 5,399 %, due 12/15/2043	41	–
11	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ13, Serie 2007 IQ13, Klasse AJ, 5,438 %, due 3/15/2044	11	–
39	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ16, Serie 2007 IQ16, Klasse AJ, 6,458 %, due 12/12/2049 *	25	–
2.182	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Serie 2005 2AR, Klasse B1, 2,645 %, due 4/25/2035 *	1.822	0,14
280	MSCG Trust 2015-ALDR, Serie 2015 ALDR, Klasse A2, 144A, 3,577 %, due 6/7/2035 *	296	0,02
2.870	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse A, 144A, 3,047 %, due 8/5/2024 ∞	2.956	0,22
933	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Serie 2016 3A, Klasse A1B, 144A, 3,250 %, due 9/25/2056 *	958	0,07
1.615	New Residential Mortgage Loan Trust 2017-6, Serie 2017 6A, Klasse A1, 144A, 4,000 %, due 8/27/2057 *	1.704	0,13
1.664	Prime Mortgage Trust 2006-DR1, Serie 2006 DR1, Klasse 2A1, 144A, 5,500 %, due 5/25/2035	1.442	0,11
239	Residential Asset Securitization Trust 2005-A15, Serie 2005 A15, Klasse 1A4, 5,750 %, due 2/25/2036	244	0,02
10	Sequoia Mortgage Trust 2004-10, Serie 2004 10, Klasse A1A, 2,792 %, due 11/20/2034 *	10	–
GBP 646	Towd Point Mortgage Funding 2016-Vantage1 Plc, Serie 2016 V1A, Klasse A1, 144A, 1,961 %, due 2/20/2054 *	788	0,06
690	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2, Serie 2017 C2, Klasse A4, 3,487 %, due 8/15/2050	753	0,06
100	VNDO 2012-6AVE Mortgage Trust, Serie 2012 6AVE, Klasse A, 144A, 2,996 %, due 11/15/2030	103	0,01
2.306	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2007-OA2 Trust, Serie 2007 OA2, Klasse 1A, 3,181 %, due 3/25/2047 *	2.136	0,16
337	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2007-OA2 Trust, Serie 2007 OA2, Klasse 2A, 2,391 %, due 3/25/2047 *	328	0,02
305	Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Serie 2015 SBC5, Klasse A, 144A, 4,104 %, due 9/14/2022 *	317	0,02
20	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2013- LC12, Serie 2013 LC12, Klasse B, 4,420 %, due 7/15/2046 *	21	–
250	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015- LC20, Serie 2015 LC20, Klasse AS, 3,467 %, due 4/15/2050	265	0,02
160	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, Serie 2015 NXS1, Klasse AS, 3,406 %, due 5/15/2048	169	0,01
6.015	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1, Serie 2017 RB1, Klasse XA, 1,432 %, due 3/15/2050 *	473	0,04
	Hypothekarisch besicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 504.578)	510.282	37,81

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 27,24 % (28. Februar 2019: 32,63 %)			
Australien – 0,22 % (28. Februar 2019: 0,30 %)			
35	BHP Billiton Finance USA Ltd, 2,875 %, due 2/24/2022	36	–
300	BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, due 9/30/2043	397	0,03
1.540	BHP Billiton Finance USA Ltd, 144A, 6,750 %, due 10/19/2075 *	1.806	0,14
200	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 3,900 %, due 7/12/2047	229	0,02
450	Westpac Banking Corp, 2,600 %, due 11/23/2020	453	0,03
		2.921	0,22
Belgien – 0,61 % (28. Februar 2019: 0,75 %)			
1.990	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650 %, due 2/1/2026	2.139	0,16
250	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, due 2/1/2046	298	0,02
196	Anheuser-Busch InBev Finance Inc, 2,650 %, due 2/1/2021	198	0,02
315	Anheuser-Busch InBev Finance Inc, 3,300 %, due 2/1/2023	328	0,02
510	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,150 %, due 1/23/2025	559	0,04
780	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, due 4/13/2028	865	0,06
1.500	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,750 %, due 1/23/2029	1.753	0,13
100	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, due 4/15/2048	116	0,01
1.540	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, due 1/23/2049	2.026	0,15
		8.282	0,61
Brasilien – 0,62 % (28. Februar 2019: 0,83 %)			
150	Petrobras Global Finance BV, 6,125 %, due 1/17/2022	161	0,01
57	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, due 3/17/2024	63	0,01
5.590	Petrobras Global Finance BV, 5,299 %, due 1/27/2025	6.058	0,45
390	Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, due 1/17/2027	464	0,03
840	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, due 6/5/2115	940	0,07
210	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, due 11/21/2036	264	0,02
390	Yamana Gold Inc, 4,625 %, due 12/15/2027	415	0,03
		8.365	0,62
Kanada – 0,17 % (28. Februar 2019: 0,22 %)			
240	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,250 %, due 5/15/2024	248	0,02
160	Bank of Montreal, 3,803 %, due 12/15/2032 *	168	0,01
290	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, due 5/30/2041	376	0,03
500	Barrick North America Finance LLC, 5,750 %, due 5/1/2043	674	0,05

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Kanada – (Fortsetzung)			
240	Cott Holdings Inc, 144A, 5,500 %, due 4/1/2025	251	0,02
20	Teck Resources Ltd, 6,000 %, due 8/15/2040	22	–
590	Toronto-Dominion Bank/ The, 3,250 %, due 6/11/2021	604	0,04
		2.343	0,17
Kaimaninseln – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
20	Ambac LSNI LLC, 144A, 7,319 %, due 2/12/2023 *	20	–
China – 0,17 % (28. Februar 2019: 0,23 %)			
1.320	CNOOC FINANCE 2015 USA LLC, 3,500 %, due 5/5/2025	1.388	0,10
820	Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 144A, 4,375 %, due 4/10/2024	892	0,07
		2.280	0,17
Kolumbien – 0,10 % (28. Februar 2019: 0,13 %)			
1.190	Ecopetrol SA, 5,875 %, due 5/28/2045	1.403	0,10
Dänemark – 0,19 % (28. Februar 2019: 0,13 %)			
1.380	Danske Bank A/S, 144A, 5,000 %, due 1/12/2022	1.456	0,11
1.020	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, due 1/12/2024	1.125	0,08
		2.581	0,19
Finnland – 0,04 % (28. Februar 2019: 0,06 %)			
550	Nordea Bank Abp, 144A, 4,875 %, due 5/13/2021	571	0,04
Frankreich – 0,94 % (28. Februar 2019: 1,16 %)			
400	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, due 5/1/2026	428	0,03
280	BNP Paribas SA, 144A, 3,375 %, due 1/9/2025	290	0,02
1.880	BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, due 1/10/2025 *	2.038	0,15
620	BNP Paribas SA, 144A, 4,625 %, due 3/13/2027	679	0,05
1.580	BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, due 8/14/2028	1.767	0,13
1.860	BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, due 1/10/2030 *	2.195	0,16
550	BNP Paribas SA, 144A, 4,375 %, due 3/1/2033 *	585	0,04
500	BPCE SA, 144A, 5,150 %, due 7/21/2024	549	0,04
590	Credit Agricole SA, 144A, 4,000 %, due 1/10/2033 *	617	0,05
620	Credit Agricole SA, 144A, 8,375 %, Perpetual *	627	0,05
340	Danone SA, 144A, 2,077 %, due 11/2/2021	339	0,03
1.110	Danone SA, 144A, 2,589 %, due 11/2/2023	1.130	0,08
240	Danone SA, 144A, 2,947 %, due 11/2/2026	249	0,02
210	Pernod Ricard SA, 144A, 4,450 %, due 1/15/2022	222	0,02
940	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, due 9/17/2024	1.004	0,07
		12.719	0,94
Deutschland – 0,04 % (28. Februar 2019: 0,05 %)			
500	Deutsche Telekom International Finance BV, 144A, 2,820 %, due 1/19/2022	507	0,04
Irland – 0,13 % (28. Februar 2019: 0,20 %)			
330	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500 %, due 5/15/2021	340	0,03
160	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,625 %, due 7/1/2022	169	0,01
340	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 6,000 %, due 2/15/2025	356	0,03
640	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,250 %, due 8/15/2022	678	0,05
50	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 4,500 %, due 3/15/2023	52	–
120	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, due 2/15/2024	130	0,01
		1.725	0,13
Israel – 0,16 % (28. Februar 2019: 0,25 %)			
530	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, Serie 2, 3,650 %, due 11/10/2021	506	0,04
170	Teva Pharmaceutical Finance IV BV, 3,650 %, due 11/10/2021	162	0,01
1.010	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200 %, due 7/21/2021	950	0,07
590	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, due 7/21/2023	499	0,04
		2.117	0,16
Italien – 0,34 % (28. Februar 2019: 0,44 %)			
500	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,125 %, due 7/14/2022	502	0,04
280	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,375 %, due 1/12/2023	284	0,02
960	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, due 6/26/2024	985	0,07
1.050	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, due 1/15/2026	1.109	0,08
220	Telecom Italia SpA/ Milano,144A, 5,303 %, due 5/30/2024	236	0,02
1.310	UniCredit SpA, 144A, 6,572 %, due 1/14/2022	1.409	0,11
		4.525	0,34
Japan – 0,05 % (28. Februar 2019: 0,07 %)			
250	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 2,998 %, due 2/22/2022	255	0,02
370	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2,058 %, due 7/14/2021	370	0,03
		625	0,05
Kasachstan – 0,03 % (28. Februar 2019: 0,04 %)			
300	KazMunayGas National Co JSC, 144A, 6,375 %, due 10/24/2048	379	0,03
Kuwait – 0,04 % (28. Februar 2019: 0,06 %)			
520	Equate Petrochemical BV, 144A, 4,250 %, due 11/3/2026	565	0,04
Luxemburg – 0,19 % (28. Februar 2019: 0,03 %)			
1.786	ArcelorMittal, 6,250 %, due 2/25/2022	1.939	0,14
60	ArcelorMittal, 6,125 %, due 6/1/2025	67	0,01
410	ArcelorMittal, 4,550 %, due 3/11/2026	430	0,03
150	ArcelorMittal, 7,000 %, due 10/15/2039	180	0,01
		2.616	0,19
Macau – 0,15 % (28. Februar 2019: 0,12 %)			
730	Sands China Ltd, 4,600 %, due 8/8/2023	779	0,06
540	Sands China Ltd, 5,125 %, due 8/8/2025	599	0,04
580	Sands China Ltd, 5,400 %, due 8/8/2028	671	0,05
		2.049	0,15
Mexiko – 0,17 % (28. Februar 2019: 0,25 %)			
100	America Movil SAB de CV, 5,000 %, due 3/30/2020	102	0,01
700	America Movil SAB de CV, 3,125 %, due 7/16/2022	720	0,06
20	America Movil SAB de CV, 6,375 %, due 3/1/2035	28	–
20	America Movil SAB de CV, 6,125 %, due 11/15/2037	28	–
590	Petroleos Mexicanos, 4,250 %, due 1/15/2025	566	0,04
260	Petroleos Mexicanos, 6,875 %, due 8/4/2026	273	0,02
25	Petroleos Mexicanos, 6,625 %, due 6/15/2035	24	–
660	Petroleos Mexicanos, 5,500 %, due 6/27/2044	569	0,04
		2.310	0,17
Marokko – 0,10 % (28. Februar 2019: 0,13 %)			
1.230	OCP SA, 144A, 4,500 %, due 10/22/2025	1.308	0,10
Niederlande – 0,66 % (28. Februar 2019: 0,92 %)			
200	ABN AMRO Bank NV, 144A, 4,750 %, due 7/28/2025	219	0,02
1.250	Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, due 12/1/2023	1.352	0,10
1.840	Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, due 8/4/2025	1.984	0,15
300	Cooperatieve Rabobank UA, 5,250 %, due 8/4/2045	390	0,03
940	Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,125 %, due 4/26/2021	957	0,07
200	ING Bank NV, 144A, 5,800 %, due 9/25/2023	222	0,02
1.490	Shell International Finance BV, 2,875 %, due 5/10/2026	1.562	0,12
160	Shell International Finance BV, 4,550 %, due 8/12/2043	198	0,01
770	Shell International Finance BV, 4,375 %, due 5/11/2045	944	0,07
270	Shell International Finance BV, 4,000 %, due 5/10/2046	318	0,02
300	UPC Holding BV, 144A, 5,500 %, due 1/15/2028	313	0,02
400	UPCB Finance IV Ltd, 144A, 5,375 %, due 1/15/2025	414	0,03
		8.873	0,66
Peru – 0,19 % (28. Februar 2019: 0,24 %)			
2.210	Southern Copper Corp, 5,250 %, due 11/8/2042	2.558	0,19
Südafrika – 0,19 % (28. Februar 2019: 0,25 %)			
280	Anglo American Capital Plc, 144A, 3,750 %, due 4/10/2022	288	0,02
670	Anglo American Capital Plc, 144A, 3,625 %, due 9/11/2024	692	0,05
530	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, due 4/10/2027	574	0,05
290	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,000 %, due 9/11/2027	299	0,02
620	Myriad International Holdings BV, 144A, 4,850 %, due 7/6/2027	705	0,05
		2.558	0,19
Spanien – 0,24 % (28. Februar 2019: 0,31 %)			
200	Banco Santander SA, 3,460 %, due 4/12/2023 *	200	0,02
400	Banco Santander SA, 3,848 %, due 4/12/2023	418	0,03

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Spanien – (Fortsetzung)			
1.400	Banco Santander SA, 4,379 %, due 4/12/2028	1.541	0,11
500	Telefonica Emisiones SAU, 4,103 %, due 3/8/2027	547	0,04
210	Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, due 3/8/2047	245	0,02
260	Telefonica Emisiones SA, 4,895 %, due 3/6/2048	291	0,02
		3.242	0,24
Schweiz – 0,87 % (28. Februar 2019: 1,02 %)			
20	ABB Finance USA Inc, 4,375 %, due 5/8/2042	25	–
1.140	Credit Suisse Group AG, 144A, 3,869 %, due 1/12/2029 *	1.215	0,09
490	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd, 4,875 %, due 5/15/2045	621	0,05
210	Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000 %, due 11/15/2041	243	0,02
10	Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, due 5/30/2023	11	–
1.570	Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, due 3/12/2024	1.654	0,12
1.280	Glencore Funding LLC, 144A, 4,625 %, due 4/29/2024	1.359	0,10
530	Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, due 3/27/2027	548	0,04
100	Glencore Funding LLC, 144A, 3,875 %, due 10/27/2027	103	0,01
700	Syngenta Finance NV, 144A, 3,933 %, due 4/23/2021	712	0,05
200	UBS AG/London, 144A, 4,500 %, due 6/26/2048	258	0,02
790	UBS Group Funding Switzerland AG, 144A, 3,491 %, due 5/23/2023	814	0,06
330	UBS Group Funding Switzerland AG, 144A, 4,125 %, due 9/24/2025	359	0,03
1.500	UBS Group Funding Switzerland AG, 144A, 4,253 %, due 3/23/2028	1.660	0,12
2.090	UBS Group Funding Switzerland AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	2.218	0,16
		11.800	0,87
Vereinigte Arabische Emirate - 0,09 % (28. Februar 2019 0,13 %)			
90	DAE Funding LLC, 144A, 5,750 %, due 11/15/2023	95	–
200	DP World Plc, 144A, 5,625 %, due 9/25/2048	239	0,02
760	DP World Plc, 5,625 %, due 9/25/2048	908	0,07
		1.242	0,09
Großbritannien – 1,90 % (28. Februar 2019: 2,10 %)			
410	Barclays Plc, 4,972 %, due 5/16/2029 *	450	0,03
1.940	Barclays Plc, 5,088 %, due 6/20/2030 *	2.017	0,15
160	BAT Capital Corp, 3,557 %, due 8/15/2027	164	0,01
2.380	BAT Capital Corp, 4,540 %, due 8/15/2047	2.391	0,18
70	BP Capital Markets Plc, 3,561 %, due 11/1/2021	72	0,01
190	BP Capital Markets Plc, 3,535 %, due 11/4/2024	203	0,01
350	BP Capital Markets Plc, 3,506 %, due 3/17/2025	373	0,03
310	Diageo Capital Plc, 4,828 %, due 7/15/2020	317	0,02
200	Fiat Chrysler Automobiles NV, 4,500 %, due 4/15/2020	203	0,01
910	HSBC Holdings Plc, 3,400 %, due 3/8/2021	925	0,07
430	HSBC Holdings Plc, 4,250 %, due 8/18/2025	455	0,03
330	HSBC Holdings Plc, 4,300 %, due 3/8/2026	359	0,03
1.300	HSBC Holdings Plc, 3,900 %, due 5/25/2026	1.393	0,10
400	HSBC Holdings Plc, 4,041 %, due 3/13/2028 *	427	0,03
2.120	HSBC Holdings Plc, 4,583 %, due 6/19/2029 *	2.372	0,18
2.200	HSBC Holdings Plc, 3,973 %, due 5/22/2030 *	2.363	0,18
340	HSBC Holdings Plc, 6,500 %, due 5/2/2036	456	0,03
800	HSBC Holdings Plc, 6,250 %, Perpetual *	818	0,06
800	HSBC Holdings Plc, 6,500 %, Perpetual *	823	0,06
1.500	Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, due 3/24/2026	1.584	0,12
780	Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, due 3/22/2028	851	0,06
200	Lloyds Banking Group Plc, 3,574 %, due 11/7/2028 *	205	0,02
87	Reynolds American Inc, 3,250 %, due 6/12/2020	88	0,01
290	American Airlines Inc, 5,850 %, due 8/15/2045	327	0,02
100	Royal Bank of Scotland Group Plc, 6,125 %, due 12/15/2022	108	0,01
230	Royal Bank of Scotland Group Plc, 6,100 %, due 6/10/2023	250	0,02
460	Royal Bank of Scotland Group Plc, 6,000 %, due 12/19/2023	501	0,04
1.300	Royal Bank of Scotland Group Plc, 5,125 %, due 5/28/2024	1.377	0,10
200	Royal Bank of Scotland Group Plc, 4,519 %, due 6/25/2024 *	210	0,02
630	Royal Bank of Scotland Group Plc, 4,269 %, due 3/22/2025 *	658	0,05
230	Royal Bank of Scotland Group Plc, 4,892 %, due 5/18/2029 *	253	0,02
1.000	Royal Bank of Scotland Group Plc, 5,076 %, due 1/27/2030 *	1.121	0,08
500	Santander UK Group Holdings Plc, 144A, 5,625 %, due 9/15/2045	580	0,04
250	Santander UK Plc, 144A, 5,000 %, due 11/7/2023	265	0,02
420	Standard Chartered Plc, 144A, 5,700 %, due 3/26/2044	528	0,04
110	Vodafone Group Plc, 5,250 %, due 5/30/2048	132	0,01
		25.619	1,90
USA – 18,64 % (28. Februar 2019: 22,18 %)			
470	3M Co, 2,375 %, due 8/26/2029	471	0,04
272	Abbott Laboratories, 3,750 %, due 11/30/2026	299	0,02
230	Abbott Laboratories, 4,750 %, due 11/30/2036	289	0,02
420	Abbott Laboratories, 4,900 %, due 11/30/2046	562	0,04
120	AbbVie Inc, 2,900 %, due 11/6/2022	122	0,01
250	AbbVie Inc, 3,600 %, due 5/14/2025	261	0,02
90	Aetna Inc, 2,800 %, due 6/15/2023	91	0,01
400	Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 7,000 %, due 9/30/2026	433	0,03
250	Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, due 5/15/2028	261	0,02
190	Allergan Funding SCS, 3,450 %, due 3/15/2022	195	0,01
590	Allergan Funding SCS, 3,800 %, due 3/15/2025	620	0,05
7	Allergan Funding SCS, 4,750 %, due 3/15/2045	8	–
470	Ally Financial Inc, 8,000 %, due 11/1/2031	659	0,05
290	Altria Group Inc, 4,750 %, due 5/5/2021	303	0,02
250	Altria Group Inc, 3,490 %, due 2/14/2022	258	0,02
420	Altria Group Inc, 2,850 %, due 8/9/2022	428	0,03
270	Altria Group Inc, 3,800 %, due 2/14/2024	286	0,02
1.630	Altria Group Inc, 4,400 %, due 2/14/2026	1.788	0,13
1.440	Altria Group Inc, 4,800 %, due 2/14/2029	1.629	0,12
580	Altria Group Inc, 5,800 %, due 2/14/2039	717	0,05
950	Altria Group Inc, 5,950 %, due 2/14/2049	1.221	0,09
190	Altria Group Inc, 6,200 %, due 2/14/2059	245	0,02
660	Amazon.com Inc, 3,150 %, due 8/22/2027	710	0,05
260	Amazon.com Inc, 3,875 %, due 8/22/2037	304	0,02
340	Amazon.com Inc, 4,950 %, due 12/5/2044	457	0,03
320	Amazon.com Inc, 4,050 %, due 8/22/2047	393	0,03
5	Ambac Assurance Corp, 144A, 5,100 %, due 6/7/2020	7	–
155	American Axle & Manufacturing Inc, 6,625 %, due 10/15/2022	157	0,01
390	American Express Credit Corp, 2,375 %, due 5/26/2020	391	0,03
70	American International Group Inc, 3,750 %, due 7/10/2025	75	0,01
234	American International Group Inc, 6,250 %, due 3/15/2037 *	247	0,02
80	Amgen Inc, 2,125 %, due 5/1/2020	80	0,01
330	Amgen Inc, 3,625 %, due 5/22/2024	351	0,03
34	Amgen Inc, 4,663 %, due 6/15/2051	41	–
542	Anadarko Petroleum Corp, 4,850 %, due 3/15/2021	560	0,04
270	Anadarko Petroleum Corp, 5,550 %, due 3/15/2026	306	0,02
730	Anadarko Petroleum Corp, 6,450 %, due 9/15/2036	920	0,07
200	Anadarko Petroleum Corp, 6,200 %, due 3/15/2040	246	0,02
520	Anadarko Petroleum Corp, 6,600 %, due 3/15/2046	689	0,05
250	Antero Resources Corp, 5,375 %, due 11/1/2021	243	0,02
180	Anthem Inc, 3,125 %, due 5/15/2022	184	0,01
530	Anthem Inc, 2,950 %, due 12/1/2022	543	0,04
200	Anthem Inc, 3,350 %, due 12/1/2024	209	0,02
840	Anthem Inc, 3,650 %, due 12/1/2027	892	0,07
75	Apache Corp, 3,250 %, due 4/15/2022	76	0,01
90	Apache Corp, 4,375 %, due 10/15/2028	92	0,01
17	Apache Corp, 6,000 %, due 1/15/2037	19	–
1.280	Apache Corp, 5,100 %, due 9/1/2040	1.297	0,10

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
390	Apache Corp, 4,750 %, due 4/15/2043	378	0,03
180	Apache Corp, 4,250 %, due 1/15/2044	164	0,01
430	Apple Inc, 2,000 %, due 11/13/2020	431	0,03
310	Apple Inc, 1,550 %, due 8/4/2021	309	0,02
720	Apple Inc, 2,450 %, due 8/4/2026	737	0,05
200	AT&T Inc, 3,400 %, due 5/15/2025	210	0,02
30	AT&T Inc, 6,100 %, due 7/15/2040	38	–
30	AT&T Inc, 6,250 %, due 3/29/2041	39	–
620	AT&T Inc, 4,350 %, due 6/15/2045	661	0,05
1.423	AT&T Inc, 4,500 %, due 3/9/2048	1.562	0,12
46	Baker Hughes a GE Co LLC, 3,200 %, due 8/15/2021	47	–
350	Ball Corp, 5,250 %, due 7/1/2025	394	0,03
280	Bank of America Corp, 3,300 %, due 1/11/2023	291	0,02
264	Bank of America Corp, 3,004 %, due 12/20/2023 *	271	0,02
680	Bank of America Corp, 3,550 %, due 3/5/2024 *	711	0,05
330	Bank of America Corp, 4,000 %, due 4/1/2024	357	0,03
1.520	Bank of America Corp, 4,200 %, due 8/26/2024	1.641	0,12
470	Bank of America Corp, 4,000 %, due 1/22/2025	502	0,04
130	Bank of America Corp, 4,450 %, due 3/3/2026	143	0,01
2.030	Bank of America Corp, 3,500 %, due 4/19/2026	2.175	0,16
1.440	Bank of America Corp, 4,250 %, due 10/22/2026	1.573	0,12
940	Bank of America Corp, 3,593 %, due 7/21/2028 *	1.005	0,07
1.770	Bank of America Corp, 3,419 %, due 12/20/2028 *	1.874	0,14
4.250	Bank of America Corp, 3,970 %, due 3/5/2029 *	4.674	0,35
1.200	Bank of America Corp, 3,974 %, due 2/7/2030 *	1.332	0,10
200	Bank of America Corp, Serie AA, 6,100 %, Perpetual *	218	0,02
560	Bank of America Corp, 4,330 %, due 3/15/2050 *	685	0,05
90	Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, due 4/1/2026	102	0,01
70	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,500 %, due 3/15/2022	73	0,01
100	Bausch Health Cos Inc, 144A, 9,000 %, due 12/15/2025	113	0,01
250	BBVA USA, 3,875 %, due 4/10/2025	262	0,02
960	Becton Dickinson and Co, 3,363 %, due 6/6/2024	1.003	0,07
93	Becton Dickinson and Co, 3,734 %, due 12/15/2024	99	0,01
55	Becton Dickinson and Co, 4,685 %, due 12/15/2044	66	0,01
1.030	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, due 1/15/2049	1.252	0,09
220	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,125 %, due 11/15/2022	222	0,02
230	Boeing Capital Corp, 4,700 %, due 10/27/2019	231	0,02
170	Boeing Co/The, 4,875 %, due 2/15/2020	172	0,01
150	Boeing Co/The, 3,100 %, due 5/1/2026	159	0,01
320	Boeing Co/The, 2,700 %, due 2/1/2027	329	0,02
200	Boeing Co/The, 2,800 %, due 3/1/2027	207	0,02
690	Boeing Co/The, 3,200 %, due 3/1/2029	735	0,05
1.160	Boeing Co/The, 3,250 %, due 2/1/2035	1.234	0,09
290	Boeing Co/The, 3,750 %, due 2/1/2050	323	0,02
690	BP Capital Markets America Inc, 3,216 %, due 11/28/2023	720	0,05
330	BP Capital Markets America Inc, 3,410 %, due 2/11/2026	352	0,03
1.150	BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, due 5/4/2026	1.206	0,09
330	Brighthouse Financial Inc, 4,700 %, due 6/22/2047	298	0,02
550	Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 2,600 %, due 5/16/2022	561	0,04
1.100	Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 2,900 %, due 7/26/2024	1.141	0,08
810	Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 3,200 %, due 6/15/2026	856	0,06
680	Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 3,400 %, due 7/26/2029	737	0,05
330	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd, 3,125 %, due 1/15/2025	326	0,02
170	Cardinal Health Inc, 2,616 %, due 6/15/2022	171	0,01
210	Cardinal Health Inc, 3,079 %, due 6/15/2024	213	0,02
40	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 5,250 %, due 9/30/2022	40	–
310	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, due 5/1/2027	329	0,02
380	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,000 %, due 2/1/2028	400	0,03
340	Celgene Corp, 2,250 %, due 8/15/2021	341	0,03
120	Celgene Corp, 3,550 %, due 8/15/2022	125	0,01
360	Celgene Corp, 3,875 %, due 8/15/2025	391	0,03
100	Celgene Corp, 5,250 %, due 8/15/2043	128	0,01
700	Celgene Corp, 5,000 %, due 8/15/2045	889	0,07
50	Centene Corp, 5,625 %, due 2/15/2021	51	–
100	Centene Corp, 4,750 %, due 5/15/2022	103	0,01
360	Centene Corp, 6,125 %, due 2/15/2024	378	0,03
20	Centene Corp, 4,750 %, due 1/15/2025	21	–
130	Centene Corp, 144A, 5,375 %, due 6/1/2026	139	0,01
410	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,579 %, due 7/23/2020	414	0,03
150	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, due 7/23/2025	166	0,01
3.320	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, due 3/15/2028	3.536	0,26
700	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, due 3/30/2029	792	0,06
740	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, due 4/1/2038	836	0,06
260	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, due 10/23/2045	322	0,02
190	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 5,125 %, due 6/30/2027	210	0,02
40	Chesapeake Energy Corp, 6,625 %, due 8/15/2020	40	–
220	Chesapeake Energy Corp, 6,125 %, due 2/15/2021	208	0,02
130	Chesapeake Energy Corp, 8,000 %, due 6/15/2027	95	0,01
340	Chevron Corp, 2,954 %, due 5/16/2026	360	0,03
110	Chubb INA Holdings Inc, 2,300 %, due 11/3/2020	110	0,01
140	Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, due 5/3/2026	150	0,01
380	Cigna Corp, 3,400 %, due 9/17/2021	390	0,03
1.010	Cigna Corp, 3,750 %, due 7/15/2023	1.062	0,08
290	Cigna Corp, 4,125 %, due 11/15/2025	316	0,02
1.730	Cigna Corp, 4,375 %, due 10/15/2028	1.936	0,14
210	Cimarex Energy Co, 4,375 %, due 6/1/2024	222	0,02
790	Cimarex Energy Co, 3,900 %, due 5/15/2027	809	0,06
270	Cintas Corp No 2, 2,900 %, due 4/1/2022	276	0,02
270	Cintas Corp No 2, 3,700 %, due 4/1/2027	297	0,02
330	CIT Group Inc, 4,750 %, due 2/16/2024	355	0,03
190	CIT Group Inc, 5,250 %, due 3/7/2025	213	0,02
350	Citigroup Inc, 4,500 %, due 1/14/2022	369	0,03
50	Citigroup Inc, 4,050 %, due 7/30/2022	52	–
250	Citigroup Inc, 3,500 %, due 5/15/2023	260	0,02
330	Citigroup Inc, 3,300 %, due 4/27/2025	349	0,03
440	Citigroup Inc, 4,400 %, due 6/10/2025	478	0,04
1.220	Citigroup Inc, 5,500 %, due 9/13/2025	1.399	0,10
110	Citigroup Inc, 4,300 %, due 11/20/2026	120	0,01
2.130	Citigroup Inc, 4,450 %, due 9/29/2027	2.345	0,17
60	Citigroup Inc, 4,125 %, due 7/25/2028	65	0,01
1.360	Citigroup Inc, 3,520 %, due 10/27/2028 *	1.442	0,11
1.750	Citigroup Inc, 4,075 %, due 4/23/2029 *	1.941	0,14
300	Citigroup Inc, 3,980 %, due 3/20/2030 *	331	0,02
1.456	Citigroup Inc, 8,125 %, due 7/15/2039	2.436	0,18
255	Citigroup Inc, 5,300 %, due 5/6/2044	326	0,02
100	Citigroup Inc, 5,950 %, Perpetual *	105	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
40	Citigroup Inc, 5,900 %, Perpetual *	42	–
740	Citigroup Inc, Serie P, 5,950 %, Perpetual *	792	0,06
130	Citigroup Inc, Serie M, 6,300 %, Perpetual *	138	0,01
160	Comcast Corp, 3,950 %, due 10/15/2025	176	0,01
310	Comcast Corp, 3,150 %, due 3/1/2026	327	0,02
2.140	Comcast Corp, 4,150 %, due 10/15/2028	2.430	0,18
1.420	Comcast Corp, 4,250 %, due 10/15/2030	1.650	0,12
60	Comcast Corp, 4,250 %, due 1/15/2033	70	0,01
60	Comcast Corp, 5,650 %, due 6/15/2035	80	0,01
60	Comcast Corp, 6,500 %, due 11/15/2035	85	0,01
940	Comcast Corp, 3,900 %, due 3/1/2038	1.055	0,08
14	Comcast Corp, 3,969 %, due 11/1/2047	16	–
920	Comcast Corp, 4,700 %, due 10/15/2048	1.154	0,09
203	Comcast Corp, 3,999 %, due 11/1/2049	230	0,02
126	Comcast Corp, 4,049 %, due 11/1/2052	144	0,01
20	CommonSpirit Health, 4,350 %, due 11/1/2042	22	–
370	Concho Resources Inc, 4,375 %, due 1/15/2025	384	0,03
60	Concho Resources Inc, 3,750 %, due 10/1/2027	63	–
580	Concho Resources Inc, 4,300 %, due 8/15/2028	632	0,05
85	ConocoPhillips Holding Co, 6,950 %, due 4/15/2029	117	0,01
640	Constellation Brands Inc, 4,750 %, due 11/15/2024	713	0,05
207	Continental Airlines 2007-1 Klasse A Pass Through Trust, Serie 071A, 5,983 %, due 4/19/2022	219	0,02
240	Continental Resources Inc/ OK, 4,500 %, due 4/15/2023	249	0,02
160	Continental Resources Inc/ OK, 3,800 %, due 6/1/2024	162	0,01
640	Continental Resources Inc/ OK, 4,375 %, due 1/15/2028	657	0,05
270	CSC Holdings LLC, 144A, 5,375 %, due 7/15/2023	278	0,02
834	CVS Health Corp, 3,350 %, due 3/9/2021	851	0,06
220	CVS Health Corp, 2,750 %, due 12/1/2022	223	0,02
1.040	CVS Health Corp, 3,700 %, due 3/9/2023	1.088	0,08
440	CVS Health Corp, 4,100 %, due 3/25/2025	471	0,04
761	CVS Health Corp, 3,875 %, due 7/20/2025	808	0,06
3.050	CVS Health Corp, 4,300 %, due 3/25/2028	3.329	0,25
440	CVS Health Corp, 5,125 %, due 7/20/2045	512	0,04
880	CVS Health Corp, 5,050 %, due 3/25/2048	1.027	0,08
23	CVS Pass-Through Trust, 144A, 5,298 %, due 1/11/2027	24	–
23	CVS Pass-Through Trust, 6,036 %, due 12/10/2028	26	–
39	CVS Pass-Through Trust, 6,943 %, due 1/10/2030	47	–
1.850	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 4,420 %, due 6/15/2021	1.908	0,14
268	Delta Air Lines 2007-1 Klasse A Pass Through Trust, Serie 071A, 6,821 %, due 8/10/2022	296	0,02
530	Devon Energy Corp, 5,850 %, due 12/15/2025	635	0,05
40	Devon Energy Corp, 5,600 %, due 7/15/2041	49	–
20	Devon Energy Corp, 4,750 %, due 5/15/2042	22	–
1.310	Devon Energy Corp, 5,000 %, due 6/15/2045	1.542	0,11
180	Diamondback Energy Inc, 5,375 %, due 5/31/2025	189	0,01
450	DISH DBS Corp, 5,875 %, due 11/15/2024	430	0,03
50	DISH DBS Corp, 7,750 %, due 7/1/2026	49	–
130	Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, due 2/15/2040	172	0,01
640	Duke Energy Ohio Inc, 3,650 %, due 2/1/2029	710	0,05
660	Eaton Corp, 2,750 %, due 11/2/2022	674	0,05
420	Eaton Corp, 4,150 %, due 11/2/2042	477	0,04
36	El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, due 6/15/2032	51	–
140	Eli Lilly & Co, 3,100 %, due 5/15/2027	150	0,01
800	Energy Transfer Operating LP, 4,500 %, due 4/15/2024	858	0,06
120	Energy Transfer Operating LP, 4,950 %, due 6/15/2028	134	0,01
280	Energy Transfer Operating LP, 5,250 %, due 4/15/2029	321	0,02
50	Energy Transfer Operating LP, 6,250 %, due 4/15/2049	62	–
90	Energy Transfer Partners LP / Regency Energy Finance Corp, 5,875 %, due 3/1/2022	97	0,01
290	Enterprise Products Operating LLC, 5,200 %, due 9/1/2020	298	0,02
1.080	Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, due 10/16/2028	1.202	0,09
210	EOG Resources Inc, 4,150 %, due 1/15/2026	234	0,02
470	Exxon Mobil Corp, 3,043 %, due 3/1/2026	499	0,04
1.130	Exxon Mobil Corp, 4,114 %, due 3/1/2046	1.373	0,10
430	Fifth Third Bancorp, 3,650 %, due 1/25/2024	456	0,03
110	FirstEnergy Corp, Serie B, 4,250 %, due 3/15/2023	117	0,01
2.660	FirstEnergy Corp, Serie B, 3,900 %, due 7/15/2027	2.862	0,21
1.948	FirstEnergy Corp, Serie C, 7,375 %, due 11/15/2031	2.794	0,21
1.000	FirstEnergy Corp, Serie C, 4,850 %, due 7/15/2047	1.224	0,09
240	Ford Motor Co, 4,750 %, due 1/15/2043	217	0,02
490	Ford Motor Credit Co LLC, 8.125 %, due 1/15/2020	500	0,04
310	Ford Motor Credit Co LLC, 3.200 %, due 1/15/2021	312	0,02
340	Fox Corp, 144A, 4,030 %, due 1/25/2024	365	0,03
1.060	Fox Corp, 144A, 5,476 %, due 1/25/2039	1.329	0,10
160	Fox Corp, 144A, 5,576 %, due 1/25/2049	209	0,02
139	Freeport-McMoRan Inc, 3,550 %, due 3/1/2022	140	0,01
10	Freeport-McMoRan Inc, 3,875 %, due 3/15/2023	10	–
30	Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, due 11/14/2024	30	–
390	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, due 3/15/2043	358	0,03
433	GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 2,342 %, due 11/15/2020	430	0,03
1.380	GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418 %, due 11/15/2035	1.405	0,10
50	General Electric Co, 5,500 %, due 1/8/2020	50	–
170	General Electric Co, 4,375 %, due 9/16/2020	173	0,01
78	General Electric Co, 5,300 %, due 2/11/2021	80	0,01
830	General Electric Co, 6,750 %, due 3/15/2032	1.018	0,08
720	General Electric Co, 6,150 %, due 8/7/2037	853	0,06
450	General Electric Co, 5,875 %, due 1/14/2038	520	0,04
1.661	General Electric Co, 6,875 %, due 1/10/2039	2.119	0,16
50	General Electric Co, 4,500 %, due 3/11/2044	51	–
50	General Motors Co, 5,150 %, due 4/1/2038	52	–
230	General Motors Co, 6,250 %, due 10/2/2043	259	0,02
330	General Motors Co, 5,950 %, due 4/1/2049	369	0,03
360	General Motors Financial Co Inc, 4,375 %, due 9/25/2021	373	0,03
40	General Motors Financial Co Inc, 3,450 %, due 4/10/2022	41	–
10	General Motors Financial Co Inc, 4,250 %, due 5/15/2023	10	–
50	General Motors Financial Co Inc, 4,350 %, due 1/17/2027	52	–
110	Gilead Sciences Inc, 2,550 %, due 9/1/2020	111	0,01
200	Gilead Sciences Inc, 3,500 %, due 2/1/2025	213	0,02
250	Gilead Sciences Inc, 4,750 %, due 3/1/2046	304	0,02
380	Gilead Sciences Inc, 4,150 %, due 3/1/2047	430	0,03
10	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,250 %, due 6/1/2025	11	–
170	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, due 4/15/2026	187	0,01
3	Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	3	–
210	Goldman Sachs Group Inc/ The, 5,375 %, due 3/15/2020	214	0,02
10	Goldman Sachs Group Inc/ The, Serie D, 6,000 %, due 6/15/2020	10	–
380	Goldman Sachs Group Inc/ The, 5,250 %, due 7/27/2021	402	0,03
750	Goldman Sachs Group Inc/ The, 2,876 %, due 10/31/2022 *	760	0,06
440	Goldman Sachs Group Inc/ The, 3,200 %, due 2/23/2023	455	0,03
320	Goldman Sachs Group Inc/ The, 4,000 %, due 3/3/2024	344	0,03
800	Goldman Sachs Group Inc/ The, 3,850 %, due 7/8/2024	853	0,06
720	Goldman Sachs Group Inc/ The, 4,250 %, due 10/21/2025	777	0,06
2.770	Goldman Sachs Group Inc/ The, 3,500 %, due 11/16/2026	2.903	0,22

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
3.750	Goldman Sachs Group Inc/ The, 3,814 %, due 4/23/2029 *	4.032	0,30
1.850	Goldman Sachs Group Inc/ The, 4,223 %, due 5/1/2029 *	2.050	0,15
670	Goldman Sachs Group Inc/ The, 6,250 %, due 2/1/2041	952	0,07
560	Goldman Sachs Group Inc/ The, 5,150 %, due 5/22/2045	680	0,05
1.050	Goldman Sachs Group Inc/ The, 4,750 %, due 10/21/2045	1.299	0,10
460	Halliburton Co, 3,800 %, due 11/15/2025	488	0,04
60	Halliburton Co, 4,850 %, due 11/15/2035	68	0,01
320	Halliburton Co, 5,000 %, due 11/15/2045	359	0,03
50	Hanesbrands Inc, 144A, 4,625 %, due 5/15/2024	53	–
200	Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, due 5/15/2026	212	0,02
150	HCA Inc, 4,750 %, due 5/1/2023	161	0,01
30	HCA Inc, 5,875 %, due 5/1/2023	33	–
100	HCA Inc, 5,000 %, due 3/15/2024	109	0,01
10	HCA Inc, 5,250 %, due 4/15/2025	11	–
10	HCA Inc, 5,875 %, due 2/15/2026	11	–
170	HCA Inc, 5,250 %, due 6/15/2026	192	0,01
30	HCA Inc, 5,375 %, due 9/1/2026	34	–
100	HCA Inc, 4,500 %, due 2/15/2027	109	0,01
70	HCA Inc, 5,625 %, due 9/1/2028	80	0,01
400	HCA Inc, 5,500 %, due 6/15/2047	460	0,03
120	Hilton Domestic Operating Co Inc, 5,125 %, due 5/1/2026	127	0,01
30	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,625 %, due 4/1/2025	31	–
330	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875 %, due 4/1/2027	349	0,03
290	HSBC Bank USA NA, 4,875 %, due 8/24/2020	298	0,02
430	Humana Inc, 3,950 %, due 3/15/2027	460	0,03
70	Humana Inc, 4,625 %, due 12/1/2042	80	0,01
90	Humana Inc, 4,950 %, due 10/1/2044	107	0,01
20	Humana Inc, 4,800 %, due 3/15/2047	24	–
50	ILFC E-Capital Trust II, 144A, 4,340 %, due 12/21/2065 *	36	–
80	Intel Corp, 3,700 %, due 7/29/2025	87	0,01
130	Intel Corp, 3,734 %, due 12/8/2047	148	0,01
1.940	International Business Machines Corp, 3,000 %, due 5/15/2024	2.020	0,15
400	International Lease Finance Corp, 8,625 %, due 1/15/2022	456	0,03
150	International Lease Finance Corp, 5,875 %, due 8/15/2022	165	0,01
50	John Deere Capital Corp, 1,700 %, due 1/15/2020	50	–
1.040	Johnson & Johnson, 3,625 %, due 3/3/2037	1.173	0,09
320	JPMorgan Chase & Co, 4,350 %, due 8/15/2021	334	0,03
100	JPMorgan Chase & Co, 4,500 %, due 1/24/2022	106	0,01
1.250	JPMorgan Chase & Co, 3,875 %, due 9/10/2024	1.337	0,10
1.400	JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, due 12/5/2024 *	1.506	0,11
970	JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, due 10/1/2027	1.084	0,08
1.000	JPMorgan Chase & Co, 3,509 %, due 1/23/2029 *	1.072	0,08
770	JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, due 7/23/2029 *	869	0,06
780	JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, due 12/5/2029 *	897	0,07
1.030	JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, due 6/1/2045	1.326	0,10
40	Kerr-Mc Gee Corp, 6,950 %, due 7/1/2024	47	–
260	Kerr-Mc Gee Corp, 7,875 %, due 9/15/2031	359	0,03
150	Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500 %, due 3/1/2021	152	0,01
380	Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500 %, due 9/1/2023	395	0,03
110	Kinder Morgan Energy Partners LP, 4,250 %, due 9/1/2024	119	0,01
130	Kinder Morgan Inc/DE 144A, 5,000 %, due 2/15/2021	135	0,01
410	Kinder Morgan Inc/DE, 4,300 %, due 3/1/2028	449	0,03
270	Kinder Morgan Inc/DE, 5,300 %, due 12/1/2034	315	0,02
30	KKR Group Finance Co II LLC, 144A, 5,500 %, due 2/1/2043	37	–
152	Kraft Heinz Foods Co, 5,375 %, due 2/10/2020	154	0,01
70	Kraft Heinz Foods Co, 3,500 %, due 7/15/2022	72	0,01
10	Kraft Heinz Foods Co, 4,000 %, due 6/15/2023	10	–
326	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 4,875 %, due 2/15/2025	336	0,03
310	Kraft Heinz Foods Co, 3,950 %, due 7/15/2025	322	0,02
140	Kraft Heinz Foods Co, 3,000 %, due 6/1/2026	138	0,01
110	Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, due 7/15/2035	118	0,01
10	Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, due 7/15/2045	11	–
70	L3Harris Technologies Inc, 4,854 %, due 4/27/2035	84	0,01
230	L3Harris Technologies Inc, 5,054 %, due 4/27/2045	294	0,02
270	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,875 %, due 11/1/2026	283	0,02
1.810	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, due 8/8/2024	1.849	0,14
160	Lehman Brothers Escrow, Serie DMTN, zero coupon, Perpetual †∞ε	–	–
170	Lehman Brothers Escrow, zero coupon, Perpetual †∞ε	–	–
1.110	Lehman Brothers Holding Inc, zero coupon, Perpetual †∞ε	–	–
960	Lehman Brothers Holdings Capital Trust Escrow, zero coupon, Perpetual †∞ε	–	–
207	Lehman Escrow Receipt, zero coupon, Perpetual †∞	3	–
79	Lehman Swap Receipt, zero coupon, Perpetual †∞	1	–
160	Lennar Corp, 4,500 %, due 4/30/2024	171	0,01
50	Lennar Corp, 4,750 %, due 5/30/2025	54	–
40	Lennar Corp, 5,000 %, due 6/15/2027	43	–
530	Lennar Corp, 4,750 %, due 11/29/2027	579	0,04
90	Lockheed Martin Corp, 3,100 %, due 1/15/2023	93	0,01
460	Lockheed Martin Corp, 3,550 %, due 1/15/2026	499	0,04
40	Lockheed Martin Corp, 4,500 %, due 5/15/2036	49	–
200	LyondellBasell Industries NV, 6,000 %, due 11/15/2021	214	0,02
370	Mars Inc, 144A, 2,700 %, due 4/1/2025	383	0,03
490	Mars Inc, 144A, 3,200 %, due 4/1/2030	523	0,04
400	McDonald's Corp, 3,700 %, due 1/30/2026	434	0,03
370	McDonald's Corp, 3,500 %, due 3/1/2027	400	0,03
460	McDonald's Corp, 3,800 %, due 4/1/2028	510	0,04
414	Medtronic Inc., 3,500 %, due 3/15/2025	447	0,03
200	Merck & Co Inc, 2,750 %, due 2/10/2025	208	0,02
300	MetLife Inc, 6,400 %, due 12/15/2036	351	0,03
50	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc, 4,500 %, due 1/15/2028	51	–
530	Microsoft Corp, 1,550 %, due 8/8/2021	529	0,04
770	Microsoft Corp, 2,400 %, due 2/6/2022	784	0,06
820	Microsoft Corp, 2,875 %, due 2/6/2024	859	0,06
200	Microsoft Corp, 2,700 %, due 2/12/2025	209	0,02
2.230	Microsoft Corp, 2,400 %, due 8/8/2026	2.307	0,17
1.400	Microsoft Corp, 3,300 %, due 2/6/2027	1.531	0,11
20	Microsoft Corp, 3,450 %, due 8/8/2036	23	–
390	Microsoft Corp, 3,750 %, due 2/12/2045	459	0,03
250	Microsoft Corp, 3,950 %, due 8/8/2056	307	0,02
30	Molson Coors Brewing Co, 3,500 %, due 5/1/2022	31	–
1.620	Morgan Stanley, 3,772 %, due 1/24/2029 *	1.757	0,13
1.070	Morgan Stanley, 4,431 %, due 1/23/2030 *	1.220	0,09
380	MPLX LP, 4,875 %, due 12/1/2024	417	0,03
230	MPLX LP, 4,000 %, due 3/15/2028	241	0,02
750	MPLX LP, 4,800 %, due 2/15/2029	835	0,06
410	MPLX LP, 4,500 %, due 4/15/2038	424	0,03
940	MPLX LP, 4,700 %, due 4/15/2048	969	0,07
360	MPLX LP, 5,500 %, due 2/15/2049	413	0,03
200	Navient Corp, 8,000 %, due 3/25/2020	207	0,02
110	NBCUniversal Media LLC, 5,950 %, due 4/1/2041	153	0,01
130	NCL Corp Ltd, 144A, 4,750 %, due 12/15/2021	132	0,01
100	Netflix Inc, 5,375 %, due 2/1/2021	104	0,01
160	Newell Brands Inc, 4,200 %, due 4/1/2026	166	0,01
110	Noble Energy Inc, 4,150 %, due 12/15/2021	114	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
370	Noble Energy Inc, 3,850 %, due 1/15/2028	386	0,03
330	Noble Energy Inc, 5,250 %, due 11/15/2043	375	0,03
180	Noble Energy Inc, 4,950 %, due 8/15/2047	200	0,02
790	Northrop Grumman Corp, 2,930 %, due 1/15/2025	818	0,06
1.140	Northrop Grumman Corp, 3,250 %, due 1/15/2028	1.212	0,09
40	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, due 3/15/2022	37	–
40	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, due 1/15/2023	36	–
380	Occidental Petroleum Corp, 2,600 %, due 8/13/2021	383	0,03
80	Occidental Petroleum Corp, 3,125 %, due 2/15/2022	81	0,01
550	Occidental Petroleum Corp, 2,700 %, due 8/15/2022	555	0,04
440	Occidental Petroleum Corp, 2,900 %, due 8/15/2024	444	0,03
410	Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, due 4/15/2026	417	0,03
300	Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, due 2/15/2027	298	0,02
720	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, due 8/15/2029	734	0,05
240	Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, due 6/15/2045	254	0,02
110	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, due 4/15/2046	112	0,01
510	Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, due 2/15/2047	507	0,04
260	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, due 3/15/2048	263	0,02
220	PepsiCo Inc, 3,125 %, due 11/1/2020	223	0,02
1.000	Philip Morris International Inc, 1,875 %, due 11/1/2019	999	0,07
310	Philip Morris International Inc, 2,900 %, due 11/15/2021	315	0,02
160	Philip Morris International Inc, 2,500 %, due 8/22/2022	162	0,01
540	Philip Morris International Inc, 2,500 %, due 11/2/2022	546	0,04
160	Philip Morris International Inc, 4,500 %, due 3/20/2042	182	0,01
270	Progress Energy Inc, 4,400 %, due 1/15/2021	277	0,02
30	QEP Resources Inc, 6,875 %, due 3/1/2021	30	–
10	QVC Inc, 5,950 %, due 3/15/2043	10	–
50	Range Resources Corp, 5,875 %, due 7/1/2022	48	–
280	Range Resources Corp, 5,000 %, due 3/15/2023	249	0,02
120	Range Resources Corp, 4,875 %, due 5/15/2025	99	0,01
20	Raytheon Co, 3,125 %, due 10/15/2020	20	–
40	Republic Services Inc, 5,000 %, due 3/1/2020	41	–
370	Republic Services Inc, 2,500 %, due 8/15/2024	376	0,03
440	Resolute Forest Products Inc, 5,875 %, due 5/15/2023	440	0,03
39	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu, 5,750 %, due 10/15/2020	39	–
69	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu, 6,875 %, due 2/15/2021	70	0,01
160	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu, 144A, 5,125 %, due 7/15/2023	165	0,01
430	salesforce.com Inc, 3,250 %, due 4/11/2023	450	0,03
140	salesforce.com Inc, 3,700 %, due 4/11/2028	156	0,01
80	Santander Holdings USA Inc, 4,500 %, due 7/17/2025	86	0,01
220	Schlumberger Holdings Corp, 144A, 4,000 %, due 12/21/2025	236	0,02
322	Schlumberger Holdings Corp, 3,900 %, due 5/17/2028	343	0,03
20	Schlumberger Norge AS, 144A, 4,200 %, due 1/15/2021	20	–
430	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, due 3/1/2032	616	0,05
150	Southwestern Electric Power Co, 6,200 %, due 3/15/2040	209	0,02
124	Spectrum Brands Inc, 6,625 %, due 11/15/2022	126	0,01
70	Spectrum Brands Inc, 5,750 %, due 7/15/2025	73	0,01
145	Sprint Capital Corp, 8,750 %, due 3/15/2032	182	0,01
250	Sprint Communications Inc, 144A, 7,000 %, due 3/1/2020	256	0,02
280	Sprint Corp, 7,250 %, due 9/15/2021	302	0,02
20	Sprint Corp, 7,875 %, due 9/15/2023	23	–
220	Sprint Corp, 7,625 %, due 2/15/2025	247	0,02
180	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,250 %, due 11/15/2023	180	0,01
30	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,125 %, due 2/1/2025	31	–
80	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,875 %, due 4/15/2026	84	0,01
130	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 6,500 %, due 7/15/2027	141	0,01
70	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 6,875 %, due 1/15/2029	78	0,01
16	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, due 12/16/2039	24	–
410	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900 %, due 9/15/2044	517	0,04
320	Time Warner Cable LLC, 4,125 %, due 2/15/2021	327	0,02
420	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, due 7/1/2038	539	0,04
560	Time Warner Cable LLC, 5,875 %, due 11/15/2040	639	0,05
85	Time Warner Entertainment Co LP, 8,375 %, due 7/15/2033	119	0,01
50	TJX Cos Inc/The, 2,250 %, due 9/15/2026	50	–
150	Toll Brothers Finance Corp, 4,375 %, due 4/15/2023	157	0,01
1.350	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, due 2/1/2026	1.729	0,13
340	Union Pacific Corp, 3,750 %, due 7/15/2025	368	0,03
1.090	Union Pacific Corp, 3,950 %, due 9/10/2028	1.227	0,09
1.260	Union Pacific Corp, 4,500 %, due 9/10/2048	1.537	0,11
180	United Rentals North America Inc, 5,875 %, due 9/15/2026	194	0,01
130	United Rentals North America Inc, 6,500 %, due 12/15/2026	142	0,01
160	United Rentals North America Inc, 4,875 %, due 1/15/2028	168	0,01
210	United Rentals North America Inc, 5,250 %, due 1/15/2030	225	0,02
650	United Technologies Corp, 3,950 %, due 8/16/2025	714	0,05
430	United Technologies Corp, 4,125 %, due 11/16/2028	492	0,04
130	United Technologies Corp, 4,500 %, due 6/1/2042	157	0,01
350	UnitedHealth Group Inc, 2,700 %, due 7/15/2020	352	0,03
30	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, due 10/15/2020	30	–
130	UnitedHealth Group Inc, 4,700 %, due 2/15/2021	134	0,01
230	UnitedHealth Group Inc, 2,875 %, due 12/15/2021	235	0,02
130	UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, due 7/15/2025	142	0,01
660	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, due 12/15/2028	741	0,06
440	UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, due 8/15/2049	484	0,04
300	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, due 8/15/2059	333	0,02
380	Univision Communications Inc, 144A, 5,125 %, due 2/15/2025	369	0,03
470	US Bank NA/Cincinnati OH, 3,150 %, due 4/26/2021	479	0,04
1.000	Verizon Communications Inc, 3,376 %, due 2/15/2025	1.062	0,08
260	Verizon Communications Inc, 2,625 %, due 8/15/2026	266	0,02
1.062	Verizon Communications Inc, 4,329 %, due 9/21/2028	1.220	0,09
190	Verizon Communications Inc, 3,875 %, due 2/8/2029	212	0,02
1.290	Verizon Communications Inc, 4,500 %, due 8/10/2033	1.523	0,11
580	Verizon Communications Inc, 5,250 %, due 3/16/2037	735	0,05
430	Verizon Communications Inc, 3,850 %, due 11/1/2042	466	0,03
40	Verizon Communications Inc, 4,125 %, due 8/15/2046	46	–
300	Verizon Communications Inc, 4,862 %, due 8/21/2046	374	0,03
50	Verizon Communications Inc, 5,500 %, due 3/16/2047	67	0,01
310	Verizon Communications Inc, 4,522 %, due 9/15/2048	373	0,03
60	Viacom Inc, 4,250 %, due 9/1/2023	64	0,01
830	Visa Inc, 3,150 %, due 12/14/2025	890	0,07

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
890	Visa Inc, 4,300 %, due 12/14/2045	1.132	0,08
390	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, due 2/15/2028	402	0,03
480	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual *	481	0,04
470	Walgreens Boots Alliance Inc, 3,450 %, due 6/1/2026	488	0,04
990	Walmart Inc, 3,700 %, due 6/26/2028	1.112	0,08
40	Walt Disney Co/The, 4,500 %, due 2/15/2021	41	–
170	Walt Disney Co/The, 6,650 %, due 11/15/2037	257	0,02
10	Walt Disney Co/The, 6,900 %, due 8/15/2039	16	–
140	Waste Management Inc, 3,500 %, due 5/15/2024	149	0,01
220	Waste Management Inc, 3,200 %, due 6/15/2026	234	0,02
480	Waste Management Inc, 3,450 %, due 6/15/2029	525	0,04
220	Waste Management Inc, 4,000 %, due 7/15/2039	254	0,02
310	Waste Management Inc, 4,150 %, due 7/15/2049	370	0,03
140	Wells Fargo & Co, 3,450 %, due 2/13/2023	146	0,01
410	Wells Fargo & Co, 4,480 %, due 1/16/2024	445	0,03
1.540	Wells Fargo & Co, 3,750 %, due 1/24/2024	1.641	0,12
870	Wells Fargo & Co, 3,000 %, due 10/23/2026	905	0,07
6.270	Wells Fargo & Co, 4,300 %, due 7/22/2027	6.949	0,52
560	Wells Fargo & Co, 3,584 %, due 5/22/2028 *	601	0,04
960	Wells Fargo & Co, 4,150 %, due 1/24/2029	1.077	0,08
580	Wells Fargo & Co, 4,900 %, due 11/17/2045	723	0,05
120	Wells Fargo & Co, 4,400 %, due 6/14/2046	140	0,01
390	Wells Fargo & Co, 4,750 %, due 12/7/2046	479	0,04
130	Wells Fargo & Co, Serie U, 5,875 %, Perpetual *	143	0,01
40	WestRock RKT LLC, 4,000 %, due 3/1/2023	42	–
190	Whiting Petroleum Corp, 5,750 %, due 3/15/2021	178	0,01
180	Williams Cos Inc/The, 5,250 %, due 3/15/2020	183	0,01
197	Williams Cos Inc/The, 7,875 %, due 9/1/2021	218	0,02
100	Williams Cos Inc/The, 3,700 %, due 1/15/2023	104	0,01
350	Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, due 1/15/2031	466	0,03
760	Williams Cos Inc/The, 7,750 %, due 6/15/2031	1.030	0,08
38	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, due 3/15/2032	55	–
40	Wm Wrigley Jr Co, 144A, 3,375 %, due 10/21/2020	41	–
70	WPX Energy Inc, 6,000 %, due 1/15/2022	72	0,01
330	WPX Energy Inc, 8,250 %, due 8/1/2023	369	0,03
110	Wyeth LLC, 5,950 %, due 4/1/2037	154	0,01
170	XPO Logistics Inc, 144A, 6,500 %, due 6/15/2022	174	0,01
		251.544	18,64
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 339.995)		367.647	27,24

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 29,17 % (28. Februar 2019 21,00 %)			
Argentinien – 0,19 % (28. Februar 2019: 0,59 %)			
ARS 1.910	Argentina POM Politica Monetaria, Serie POM, 66,777 %, due 6/21/2020 *	11	–
ARS 24.020	Argentine Bonos del Tesoro, 18,200 %, due 10/3/2021	121	0,01
550	Argentine Republic Government International Bond, 6,875 %, due 4/22/2021	235	0,02
1.590	Argentine Republic Government International Bond, 5,625 %, due 1/26/2022	636	0,05
1.060	Argentine Republic Government International Bond, 7,500 %, due 4/22/2026	415	0,03
370	Argentine Republic Government International Bond, 7,125 %, due 7/6/2036	140	0,01
1.850	Argentine Republic Government International Bond, 3,750 %, due 12/31/2038	673	0,05
170	Argentine Republic Government International Bond, 7,625 %, due 4/22/2046	66	–
370	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144A, 6,500 %, due 2/15/2023	120	0,01
320	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144A, 7,875 %, due 6/15/2027	107	0,01
		2.524	0,19
Brasilien – 1,02 % (28. Februar 2019: 1,46 %)			
BRL 18.800	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2021	4.784	0,35
BRL 9.026	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2023	2.391	0,18
BRL 1.633	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2027	452	0,03
350	Brazilian Government International Bond, 2,625 %, due 1/5/2023	350	0,03
770	Brazilian Government International Bond, 4,625 %, due 1/13/2028	829	0,06
760	Brazilian Government International Bond, 5,625 %, due 1/7/2041	870	0,07
3.820	Brazilian Government International Bond, 5,000 %, due 1/27/2045	4.071	0,30
		13.747	1,02
Kolumbien – 0,07 % (28. Februar 2019: 0,08 %)			
710	Colombia Government International Bond, 5,625 %, due 2/26/2044	916	0,07
Ecuador – 0,03 % (28. Februar 2019: 0,05 %)			
460	Ecuador Government International Bond, 144A, 7,875 %, due 1/23/2028	431	0,03
Ägypten – 0,05 % (28. Februar 2019: 0,08 %)			
700	Egypt Government International Bond, 144A, 5,577 %, due 2/21/2023	723	0,05

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Indonesien – 0,45 % (28. Februar 2019: 0,59 %)			
650	Indonesia Government International Bond, 3,750 %, due 4/25/2022	671	0,05
1.510	Indonesia Government International Bond, 144A, 5,875 %, due 1/15/2024	1.712	0,13
200	Indonesia Government International Bond, 144A, 3,850 %, due 7/18/2027	215	0,01
390	Indonesia Government International Bond, 3,500 %, due 1/11/2028	410	0,03
1.650	Indonesia Government International Bond, 144A, 5,125 %, due 1/15/2045	2.028	0,15
280	Indonesia Government International Bond, 5,125 %, due 1/15/2045	344	0,02
200	Indonesia Government International Bond, 144A, 5,250 %, due 1/8/2047	252	0,02
430	Indonesia Government International Bond, 4,350 %, due 1/11/2048	490	0,04
		6.122	0,45
Kuwait – 0,07 % (28. Februar 2019: 0,09 %)			
860	Kuwait International Government Bond, 144A, 3,500 %, due 3/20/2027	946	0,07
Mexiko – 1,51 % (28. Februar 2019: 2,13 %)			
MXN 35.113	Mexican Bonos, Series M, 6,500 %, due 6/9/2022	1.734	0,13
MXN 6.990	Mexican Bonos, Serie M 20, 10,000 %, due 12/5/2024	397	0,03
MXN 42.040	Mexican Bonos, Serie M 20, 8,500 %, due 5/31/2029	2.321	0,17
MXN 132.047	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, due 11/13/2042	6.798	0,51
MXN 158.990	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, due 11/7/2047	8.414	0,62
400	Mexico Government International Bond, 4,600 %, due 2/10/2048	438	0,03
190	Mexico Government International Bond, 5,750 %, due 10/12/2110	225	0,02
		20.327	1,51
Nigeria – 0,02 % (28. Februar 2019: 0,03 %)			
300	Nigeria Government International Bond, 144A, 6,500 %, due 11/28/2027	300	0,02
Peru – 0,07 % (28. Februar 2019: 0,08 %)			
50	Peruvian Government International Bond, 6,550 %, due 3/14/2037	76	–
580	Peruvian Government International Bond, 5,625 %, due 11/18/2050	886	0,07
		962	0,07
Polen – 0,12 % (28. Februar 2019: 0,16 %)			
1.420	Republic of Poland Government International Bond, 4,000 %, due 1/22/2024	1.548	0,12
Katar – 0,24 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
820	Qatar Government International Bond, 144A, 4,000 %, due 3/14/2029	938	0,07
1.810	Qatar Government International Bond, 144A, 4,817 %, due 3/14/2049	2.333	0,17
		3.271	0,24
Russland – 1,10 % (28. Februar 2019: 0,92 %)			
RUB 52.900	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6211, 7,000 %, due 1/25/2023	801	0,06
RUB 116.430	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6215, 7,000 %, due 8/16/2023	1.763	0,13

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Russland – (Fortsetzung)			
RUB 16.270	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6219, 7,750 %, due 9/16/2026	256	0,02
RUB 143.230	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6207, 8,150 %, due 2/3/2027	2.300	0,17
RUB 258.861	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, due 1/19/2028	3.915	0,29
RUB 122.770	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, due 5/23/2029	1.828	0,14
RUB 232.730	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6228, 7,650 %, due 4/10/2030	3.643	0,27
RUB 22.030	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6225, 7,250 %, due 5/10/2034	332	0,02
		14.838	1,10
Vereinigte Arabische Emirate - 0,08 % (28. Februar 2019 0,11 %)			
1.050	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 2,500 %, due 10/11/2022	1.068	0,08
USA – 24,15 % (28. Februar 2019: 14,63 %)			
6.540	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 9/9/2019	6.538	0,48
3.540	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 9/20/2019	3.537	0,26
10.690	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 9/27/2019	10.675	0,79
6.540	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 10/28/2019	6.520	0,48
350	Federal Home Loan Banks, 2,125 %, due 2/11/2020	350	0,03
1.890	Federal National Mortgage Association, zero coupon, due 10/9/2019	1.886	0,14
1.440	Federal National Mortgage Association, 6,625 %, due 11/15/2030	2.147	0,16
500	United States Treasury Bill, zero coupon, due 11/7/2019	498	0,04
170	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,125 %, due 2/15/2040 β	277	0,02
3.190	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, due 2/15/2044 β	4.367	0,32
2.980	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,750 %, due 2/15/2045 β	3.552	0,26
3.060	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, due 2/15/2046 β	3.845	0,29
10.080	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, due 2/15/2049 β	12.162	0,90
2.030	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 2/29/2020	2.033	0,15
40	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 3/31/2020	40	–
22.740	United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, due 2/28/2021	23.033	1,71
20.240	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 4/30/2021	20.456	1,52
6.340	United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 5/31/2021	6.400	0,47
150	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 4/30/2024	156	0,01
2.800	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 7/31/2024	2.847	0,21
9.770	United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 5/31/2026 ≠	10.188	0,76
30	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, due 7/31/2026	31	–
8.980	United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, due 5/15/2044	11.510	0,85
1.700	United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, due 2/15/2045	1.887	0,14
4.260	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 8/15/2045	5.058	0,38
28.330	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, due 8/15/2047	33.105	2,45
47.370	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2048	58.067	4,30
17.330	United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, due 5/15/2048	21.738	1,61
17.650	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	21.742	1,61
2.520	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	3.036	0,23
45.380	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 8/15/2049	48.257	3,58
		325.938	24,15
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 364.238)		393.661	29,17
Schuldscheindarlehen – 3,10 % (28. Februar 2019: 2,24 %)			
310	1011778 BC ULC, 4,484 %, due 2/16/2024 *	310	0,02
562	Albertson's LLC, 5,234 %, due 8/7/2026 *	564	0,04
373	Allied Universal Holdco LLC, 6,507 %, due 7/12/2026 *	373	0,03
37	Allied Universal Holdco LLC, 6,507 %, due 7/12/2026 *	37	–
108	American Axle & Manufacturing Inc, 4,520 %, due 4/6/2024 *	106	0,01
620	Aramark Services Inc, 4,080 %, due 3/11/2025 *	621	0,05
796	Asurion LLC, 5,234 %, due 8/4/2022 *	798	0,06
1.117	Asurion LLC, 5,234 %, due 11/3/2024 *	1.118	0,08
149	Atlantic Aviation Inc, 5,990 %, due 11/30/2025 *	150	0,01
585	Avolon TLB Borrower 1 U.S. LLC, 4,021 %, due 1/15/2025 *	587	0,04
401	Berry Global Inc, 4,451 %, due 10/1/2022 *	401	0,03
620	Beta Sub LLC, 6,729 %, due 5/24/2026 *	618	0,05
220	Blackstone CQP Holdco LP, 5,887 %, due 6/7/2024 *	220	0,02
267	Brightview Landscapes LLC, 4,750 %, due 8/15/2025 *	268	0,02
1.426	Brookfield WEC Holdings Inc, 5,734 %, due 8/1/2025 *	1.431	0,11
932	Caesars Resort Collection LLC, 4,984 %, due 12/22/2024 *	919	0,07
381	CBS Radio Inc, 4,991 %, due 11/17/2024 *	382	0,03
220	CEOC LLC, 4,234 %, due 10/6/2024 *	220	0,02
1.411	Change Healthcare Holdings LLC, 4,734 %, due 3/1/2024 *	1.396	0,10
481	Charter Communications Operating LLC, 4,330 %, due 4/30/2025 *	482	0,04
499	Citadel Securities LP, 5,734 %, due 2/27/2026 *	499	0,04
651	CityCenter Holdings LLC, 4,484 %, due 4/18/2024 *	652	0,05
985	CWGS Group LLC, 4,984 %, due 11/8/2023 *	854	0,06
1.180	DCert Buyer Inc, 0,000 %, due 8/8/2026 *	1.181	0,09
420	Dell International LLC, 4,240 %, due 9/7/2023 *	422	0,03
300	Diamond Sports Group LLC, 5,420 %, due 7/18/2026 *	301	0,02
1.426	DigiCert Holdings Inc, 6,234 %, due 10/31/2024 *	1.428	0,11
907	Edelman Financial Center LLC/The, 5,432 %, due 7/19/2025 *	908	0,07
309	First Eagle Holdings Inc, 5,080 %, due 12/1/2024 *	309	0,02
190	Focus Financial Partners LLC, 4,734 %, due 7/3/2024 *	191	0,01
254	Four Seasons Hotels Ltd, 4,234 %, due 11/30/2023 *	254	0,02
271	Golden Nugget Inc, 4,932 %, due 10/4/2023 *	271	0,02
290	HCA Inc, 4,330 %, due 3/13/2025 *	291	0,02
425	Hilton Worldwide Finance LLC, 4,016 %, due 6/21/2026 *	427	0,03
603	iHeartCommunications Inc, 6,230 %, due 5/1/2026 *	606	0,04
590	Intelsat Jackson Holdings S.A., 5,991 %, due 11/27/2023 *	591	0,04
567	Intrawest Resorts Holdings Inc, 5,234 %, due 7/31/2024 *	567	0,04
132	Jaguar Holding Co II, 4,734 %, due 8/18/2022 *	132	0,01
638	Jane Street Group LLC, 5,234 %, due 8/25/2022 *	636	0,05
1.260	Level 3 Financing Inc, 4,484 %, due 2/22/2024 *	1.263	0,09
109	LPL Holdings Inc, 4,519 %, due 9/21/2024 *	110	0,01
769	McAfee LLC, 5,991 %, due 9/29/2024 *	770	0,06
384	MGM Growth Properties Operating Partnership, 4,234 %, due 3/19/2025 *	385	0,03
277	Michaels Stores Inc, 4,769 %, due 1/28/2023 *	263	0,02
1.214	MPH Acquisition Holdings LLC, 5,080 %, due 6/7/2023 *	1.132	0,08
750	Nexstar Broadcasting Inc, 0,000 %, due 6/20/2026 *	751	0,06
70	Nexstar Broadcasting Inc, 0,000 %, due 6/20/2026 *	70	–
800	Panther BF Aggregator 2 LP, 5,734 %, due 3/18/2026 *	788	0,06
431	Party City Holdings Inc, 4,740 %, due 8/19/2022 *	427	0,03
400	PCI Gaming Authority, 5,234 %, due 5/15/2026 *	403	0,03
635	Phoenix Guarantor Inc, 6,744 %, due 3/5/2026 *	632	0,05
205	Post Holdings Inc, 4,270 %, due 5/24/2024 *	205	0,01
1.195	Prime Security Services Borrower LLC, 4,984 %, due 5/2/2022 *	1.196	0,09
1.405	RegionalCare Hospital Partners Holding, 6,769 %, due 11/16/2025 *	1.397	0,10
915	Reynolds Group Holdings Inc, 4,984 %, due 2/5/2023 *	915	0,07
1.068	RPI Finance Trust, 4,234 %, due 4/17/2023 *	1.071	0,08
1.044	Scientific Games International Inc, 4,984 %, due 8/14/2024 *	1.034	0,08

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Schuldscheindarlehen – (Fortsetzung)			
27	Servicemaster Co LLC/The, 4,734 %, due 11/8/2023 *	27	–
46	Stars Group Holdings BV, 5,830 %, due 7/10/2025 *	47	0,01
928	Station Casinos LLC, 4,740 %, due 6/8/2023 *	930	0,07
1.506	TKC Holdings Inc, 5,990 %, due 2/1/2023 *	1.474	0,11
301	Trans Union LLC, 4,234 %, due 4/9/2023 *	302	0,02
648	UFC Holdings LLC, 5,490 %, due 4/29/2026 *	649	0,05
768	Univision Communications Inc, 4,984 %, due 3/15/2024 *	736	0,05
269	Valeant Pharmaceuticals International, 5,201 %, due 5/28/2025 *	270	0,02
140	VICI Properties 1 LLC, 4,272 %, due 12/22/2024 *	140	0,01
742	Virgin Media Bristol LLC, 4,695 %, due 1/31/2026 *	743	0,05
988	VVC Holding Corp, 6,701 %, due 2/11/2026 *	984	0,07
451	Western Digital Corp, 4,012 %, due 4/29/2023 *	450	0,03
770	Ziggo Secured Finance Partnership, 4,695 %, due 4/23/2025 *	766	0,06
Loan Notes insgesamt (Anschaffungskosten USD 42.189)		41.851	3,10
Rückkaufvereinbarungen – 6,62 % (28. Februar 2019 7,66 %)			
USA – 6,62 % (28. Februar 2019: 7,66 %)			
89.400	Bank of America Merrill Lynch, Rückkaufvereinbarung für Rückkauf zu USD 89.421.158 (durch US Treasury Note/Bond besichert, 2,750 %, due 7/31/2023, Marktwert USD 91.067.651), 2,130 %, due 9/3/2019	89.400	6,62
Rückkaufvereinbarungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 89.400)		89.400	6,62
Investmentfonds - 0,72 % (28. Februar 2019 0,00 %)			
798	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse M	9.699	0,72
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 10.082)		9.699	0,72
Vorzugsaktien – 0,01 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
USA – 0,01 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
1	Citigroup Capital XIII	14	–
2	GMAC Capital Trust I, Series 2	43	0,01
		57	0,01
Vorzugsaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 54)		57	0,01
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten USD 1.403.237)		1.466.050	108,63

Kontrakte (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Gekaufte Optionen – 0,18 % (28. Februar 2019: 0,06 %)			
–	IMM Euro$ December 2019 Call 97,3750, due 12/16/2019	214	0,02
–	IMM Euro$ December 2019 Call 98,1250, due 12/16/2019	46	–
–	U.S. 10 Year October 2019 Call 131,50, due 9/20/2019	323	0,03
–	U.S. 10 Year October 2019 Call 132,00, due 9/20/2019	142	0,01
–	U.S. 10 Year October 2019 Call 132,25, due 9/20/2019	125	0,01
–	U.S. 10 Year October 2019 Put 131,25, due 9/20/2019	25	–
5.820	USD Call/CNH Put 6,9350, due 9/3/2019	186	0,01
24.300	USD Call/EUR Put 1,1301, due 10/22/2019	640	0,05
21.521	USD Call/EUR Put 1,1395, due 11/5/2019	715	0,05
Gekaufte Optionen insgesamt (Anschaffungskosten USD 1.536)		2.416	0,18
Credit Default Swaps – 0,21 % (28. Februar 2019 0,30 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		2.921	0,21
Zinsswaps – 0,48 % (28. Februar 2019: 0,34 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		6.449	0,48
Devisenterminkontrakte – 0,21 % (28. Februar 2019 0,25 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		2.778	0,21
Futures – 0,45 % (28. Februar 2019: 0,35 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		6.032	0,45
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		1.486.646	110,16
Verkaufte Optionen – (0,07 %) (28. Februar 2019: (0,03 %))			
–	IMM Euro$ December 2019 Call 97,6250, due 12/16/2019	(293)	(0,02)
–	U.S. 10 Year October 2019 Call 128,50, due 9/20/2019	(226)	(0,02)
–	U.S. 10 Year October 2019 Call 133,00, due 9/20/2019	(16)	–
–	U.S. 10 Year October 2019 Call 133,50, due 9/20/2019	(69)	(0,01)
–	U.S. 10 Year October 2019 Call 134,00, due 9/20/2019	(6)	–
–	U.S. 10 Year October 2019 Put 128,00, due 9/20/2019	–	–
–	U.S. 10 Year October 2019 Put 130,50, due 9/20/2019	(24)	–
–	U.S. 5 Year October 2019 Call 121,00, due 9/20/2019	(14)	–
–	U.S. 5 Year October 2019 Put 118,25, due 9/20/2019	(2)	–
–	U.S. Bond October 2019 Call 166,00, due 9/20/2019	(179)	(0,01)
–	U.S. Bond October 2019 Call 167,00, due 9/20/2019	(34)	–
(11.640)	USD Call/CNH Put 7,1275, due 9/3/2019	(58)	(0,01)
Veräußerte Optionen gesamt (Anschaffungskosten USD (426))		(921)	(0,07)
Zinsswaps – (1,85 %) (28. Februar 2019 (0,36 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(24.960)	(1,85)
Devisenterminkontrakte – (0,46 %) (28. Februar 2019 (0,14 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(6.187)	(0,46)

Kontrakte (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Futures – (0,43 %) (28. Februar 2019: 0,56 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(5.713)	(0,43)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		(37.781)	(2,81)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		1.448.865	107,35
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(99.235)	(7,35)
Nettovermögen insgesamt	USD	1.349.630	100,00

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

144A Von der Registrierung 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 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 132.094.000 und machten 9,80 % des Nettovermögens aus,

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

† Illiquide.

∞ Das Wertpapier wurde vom Anlageverwalter nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.

ε Für das Wertpapier besteht am 31. August 2019 Zahlungsausfall.

≠ Das Wertpapier war am 31. August 2019 (ganz oder teilweise) als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet.

± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

Die Gegenparteien für OTC-Optionen sind BNP Paribas und Citi.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual	– Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen
REMIC	- Real Estate Mortgage Investment Conduit
TBA	– To Be Announced (wird angekündigt)
ARS	– Argentinischer Peso
BRL	– Brasilianischer Real
GBP	– Britisches Pfund
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	83,20
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	2,63
Investmentfonds	0,61
Derivate	1,29
Geldmarktinstrumente	5,61
Sonstige Vermögenswerte	6,66
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kauf/Verkauf Schutz	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)		wert (in Tsd.)
Barclays	CDX.NA.HY, 5,000 %	Verkauf	20.6.24	8.212	USD	551
Barclays	CDX.NA.IG, 1,000 %	Verkauf	20.6.24	112.130		2.370
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2.802)					USD	2.921
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)						–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2.802)					USD	2.921

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Ende der Laufzeit	Nomineller Betrag (in Tsd.)		wert (in Tsd.)
Barclays	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 2,250 %	26.4.22	59.083	USD	631
Barclays	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 1,850 %	15.6.22	30.470		361
Barclays	Pay Fixed 2,300 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	26.4.23	60.191		(659)
Barclays	Pay Fixed 2,250 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	31.12.25	26.536		(1.502)
Barclays	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	31.1.26	58.059		(4.222)
Barclays	Pay Fixed 1,550 %, Receive Floating USD Fed Funds Rate	30.4.26	35.916		(1.175)
Barclays	Pay Fixed 1,850 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	30.4.26	81.767		(2.800)
Barclays	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450 %	18.7.29	142.060		289
Barclays	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,440 %	20.7.29	147.960		295
Barclays	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 3,000 %	15.2.36	16.899		3.807
Barclays	Pay Fixed 3,330 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.2.44	13.576		(5.119)
Barclays	Pay Fixed 2,875 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.5.44	3.379		(958)
Barclays	Pay Fixed 3,000 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.5.44	12.580		(3.901)
Barclays	Pay Fixed 2,750 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.8.44	13.158		(3.408)
Barclays	Pay Fixed 1,810 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.44	4.272		(250)
Barclays	Pay Fixed 1,850 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.44	6.642		(446)
Barclays	Pay Fixed 1,498 %, Receive Floating EUR 6M Euribor Reuters	23.8.47	1.042		(472)
Citi	Pay Floating BRL CDI CETIP, Receive Fixed 8,410 %	1.3.20	26.600		197
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 8,410 %	1.3.20	15.600		115
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 8,410 %	1.3.20	76.790		566
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 8,410 %	1.3.20	17.400		128
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 8,410 %	1.3.20	8.170		60
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	1.4.27	16.899		(15)
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	1.4.27	15.900		(14)
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	1.4.27	13.400		(12)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,044 %	1.4.27	11.000		(7)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 3.184				USD	6.449
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (3.358))					(24.960)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (174))				USD	8.511)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNP Paribas	Kauf	CNH	5.967	Verkauf	USD	860	USD	(27)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	43	Verkauf	EUR	39		–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	18	Verkauf	USD	20		–
03.09.19	Citi	Kauf	USD	861	Verkauf	CNH	5.966		27
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	EUR	4		–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	60	Verkauf	USD	66		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	12	Verkauf	AUD	18		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	317	Verkauf	EUR	284		3
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	26	Verkauf	USD	32		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	8.223	Verkauf	USD	5.578		(38)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	66.899	Verkauf	USD	75.041		(1.457)
23.09.19	JP Morgan	Kauf	ARS	33.360	Verkauf	USD	679		(159)
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	20.480	Verkauf	CNH	141.106		804
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	10.382	Verkauf	EUR	9.250		180
17.10.19	Barclays	Kauf	CAD	57.869	Verkauf	USD	44.159		(665)
17.10.19	Barclays	Kauf	GBP	4.405	Verkauf	USD	5.536		(166)
17.10.19	Barclays	Kauf	ZAR	29.450	Verkauf	USD	2.068		(138)
17.10.19	Barclays	Kauf	IDR	219.474.873	Verkauf	USD	15.283		79
17.10.19	Barclays	Kauf	INR	723.945	Verkauf	USD	10.300		(271)
17.10.19	BNP Paribas	Kauf	USD	5.218	Verkauf	BRL	19.682		480
17.10.19	Citi	Kauf	USD	128	Verkauf	COP	415.610		8
17.10.19	Citi	Kauf	USD	6.056	Verkauf	EUR	5.403		96
17.10.19	Citi	Kauf	USD	1.452	Verkauf	JPY	156.353		(25)
17.10.19	Citi	Kauf	USD	4.703	Verkauf	MXN	90.881		203
17.10.19	Citi	Kauf	USD	479	Verkauf	RUB	30.937		18
17.10.19	Citi	Kauf	BRL	88.893	Verkauf	USD	23.394		(1.993)
17.10.19	Citi	Kauf	EUR	7.499	Verkauf	USD	8.426		(155)
17.10.19	Citi	Kauf	AUD	1.690	Verkauf	USD	1.173		(34)
17.10.19	Citi	Kauf	MXN	382.513	Verkauf	USD	19.697		(758)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
17.10.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	6.336	Verkauf	BRL	23.860	USD	592
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	5.869	Verkauf	EUR	5.174		162
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	7.807	Verkauf	PHP	402.041		113
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	339	Verkauf	RUB	21.906		13
17.10.19	JP Morgan	Kauf	TWD	2.187	Verkauf	USD	71		(1)
23.10.19	Citi	Kauf	EUR	10.970	Verkauf	USD	12.397		(292)
21.11.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	1.457	Verkauf	GBP	1.200		(8)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2.293)									2.778
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (1.304))									(6.187)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 989)								USD	(3.409)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro$ December 2019	200	USD 49.070	USD 240
90 Day Euro$ June 2020	334	82.335	1.088
90 Day Euro$ March 2021	56	13.837	196
90 Day Euro$ September 2019	(757)	(185.347)	(82)
Euro FX Currency September 2019	14	1.923	(73)
Euro-BTP September 2019	244	38.968	3.385
Euro-Bund December 2019	(268)	(51.923)	3
Euro-Bund September 2019	(482)	(94.877)	(4.385)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2019	(26)	(6.409)	(800)
Fed Fund 30 Day November 2019	(501)	(205.197)	125
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2019	(13)	(18.992)	(204)
Mexican Peso Currency September 2019	18	448	(10)
U.S. 10 Year Note (CBT) December 2019	867	114.200	243
U.S. 2 Year Note (CBT) December 2019	5	1.081	1
U.S. 5 Year Note (CBT) December 2019	(366)	(43.911)	(159)
U.S. Long Bond (CBT) December 2019	34	5.619	12
U.S. Ultra Bond (CBT) December 2019	300	59.231	739
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 3.224)			USD 6.032
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (5.196))			(5.713)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (1.972))			USD 319

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)			wert (in Tsd.) EUR	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 47,68 % (28. Februar 2019: 47,99 %)				
Belgien – 1,62 % (28. Februar 2019: 1,67 %)				
	290	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2,750 %, due 3/17/2036	375	0,30
	1.100	KBC Group NV, 0,132 %, due 11/24/2022 *	1.109	0,90
	500	KBC Group NV, 1,875 %, due 3/11/2027 *	522	0,42
			2.006	1,62
Brasilien – 0,36 % (28. Februar 2019: 0,38 %)				
	386	Petrobras Global Finance BV, 5,875 %, due 3/7/2022	443	0,36
Kanada – 1,53 % (28. Februar 2019: 1,53 %)				
USD	130	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,250 %, due 5/15/2024	122	0,10
	1.140	Bank of Nova Scotia/The, 0,247 %, due 10/5/2022 *	1.153	0,93
	600	Toronto-Dominion Bank/The, 0,375 %, due 4/27/2023	620	0,50
			1.895	1,53
Dänemark – 1,06 % (28. Februar 2019: 1,12 %)				
	390	Danske Bank A/S, 0,750 %, due 6/2/2023	403	0,33
	910	Nykredit Realkredit A/S, 0,142 %, due 6/2/2022 *	909	0,73
			1.312	1,06
Frankreich – 2,78 % (28. Februar 2019: 2,97 %)				
	168	Altice France SA/France, 5,625 %, due 5/15/2024	174	0,14
	900	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0,037 %, due 6/3/2020 *	903	0,73
	460	BNP Paribas SA, 2,875 %, due 3/20/2026 *	481	0,39
	340	Europcar Mobility Group, 4,000 %, due 4/30/2026	354	0,28
	540	RCI Banque SA, 0,292 %, due 4/12/2021 *	542	0,44
	200	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 2,125 %, due 9/27/2038	256	0,21
	700	Thales SA, 0,750 %, due 1/23/2025	732	0,59
			3.442	2,78
Deutschland – 6,74 % (28. Februar 2019: 4,85 %)				
	400	Allianz Finance II BV, 5,750 %, due 7/8/2041 *	443	0,36
	100	Allianz SE, 4,750 %, Perpetual *	117	0,09
	300	Bayer Capital Corp BV, 0,625 %, due 12/15/2022	307	0,25
	700	Daimler International Finance BV, 0,000 %, due 5/11/2022 *	700	0,56
	350	Hannover Finance Luxembourg SA, 5,750 %, due 9/14/2040 *	371	0,30
	2.380	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0,050 %, due 12/18/2029	2.491	2,01
	300	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 6,250 %, due 5/26/2042 *	352	0,28
	400	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, due 5/26/2049 *	485	0,39
	1.020	NRW Bank, 0,375 %, due 5/16/2029	1.094	0,88
	900	Volkswagen Leasing GmbH, 0,096 %, due 7/6/2021 *	901	0,73
	1.100	Vonovia Finance BV, 0,112 %, due 12/22/2022 *	1.102	0,89
			8.363	6,74
Israel – 0,24 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
USD	370	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, due 12/18/2022	295	0,24
Italien – 0,39 % (28. Februar 2019: 0,17 %)				
	200	Intesa Sanpaolo SpA, 1,125 %, due 3/4/2022	205	0,16
	190	Telecom Italia Finance SA, 7,750 %, due 1/24/2033	284	0,23
			489	0,39
Japan – 0,54 % (28. Februar 2019: 0,56 %)				
	300	Asahi Group Holdings Ltd, 1,151 %, due 9/19/2025	316	0,26
	340	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 0,680 %, due 1/26/2023	349	0,28
			665	0,54
Jersey – 0,24 % (28. Februar 2019: 0,26 %)				
	290	LHC3 Plc, 4,125 %, due 8/15/2024	301	0,24
Luxemburg – 1,13 % (28. Februar 2019: 1,12 %)				
	528	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,200 %, due 7/24/2025	571	0,46
	260	Prologis International Funding II SA, 2,375 %, due 11/14/2030	306	0,24
	500	SELP Finance Sarl, 1,500 %, due 11/20/2025	530	0,43
			1.407	1,13
Niederlande – 2,44 % (28. Februar 2019: 2,33 %)				
	850	ABN AMRO Bank NV, 7,125 %, due 7/6/2022	1.021	0,82
	200	ABN AMRO Bank NV, 2,875 %, due 6/30/2025 *	205	0,17
	200	Cooperatieve Rabobank UA, 6,625 %, Perpetual *	220	0,18
	320	Enexis Holding NV, 0,750 %, due 7/2/2031	337	0,27
	300	ING Groep NV, 3,000 %, due 4/11/2028 *	328	0,26
	560	IPD 3 BV, 4,500 %, due 7/15/2022 *	563	0,45
	320	TenneT Holding BV, 1,375 %, due 6/5/2028	357	0,29
			3.031	2,44
Norwegen – 0,62 % (28. Februar 2019: 0,66 %)				
	350	DNB Bank ASA, 1,250 %, due 3/1/2027 *	359	0,29
	400	SpareBank 1 SMN, 0,750 %, due 7/3/2023	414	0,33
			773	0,62
Polen – 0,42 % (28. Februar 2019: 0,46 %)				
	520	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA, 0,750 %, due 7/25/2021	528	0,42
Südafrika – 0,27 % (28. Februar 2019: 0,27 %)				
	310	Anglo American Capital Plc, 1,625 %, due 9/18/2025	334	0,27
Spanien – 0,92 % (28. Februar 2019: 0,94 %)				
	300	Banco Santander SA, 2,500 %, due 3/18/2025	330	0,26
	300	Telefonica Emisiones 2,9320 % Eseur 17/10/29 Eur, 2,932 %, due 10/17/2029	373	0,30
	440	Tendam Brands SAU, 5,250 %, due 9/15/2024 *	443	0,36
			1.146	0,92
Supranational – 8,20 % (28. Februar 2019: 7,54 %)				
	780	African Development Bank, 0,500 %, due 3/21/2029	845	0,68
	4.490	European Financial Stability Facility, 0,750 %, due 5/3/2027	4.922	3,97
	3.960	European Stability Mechanism, Serie EUR, 0,750 %, due 9/5/2028	4.396	3,55
			10.163	8,20
Schweden – 1,77 % (28. Februar 2019: 2,44 %)				
	1.400	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,182 %, due 5/26/2020 *	1.406	1,13
	760	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, due 3/2/2028 *	788	0,64
			2.194	1,77
Schweiz – 1,97 % (28. Februar 2019: 2,05 %)				
	970	Glencore Finance Europe Ltd, 1,750 %, due 3/17/2025	1.024	0,83
	450	UBS AG, 4,750 %, due 2/12/2026 *	479	0,39
	330	UBS Group Funding Switzerland AG, 1,750 %, due 11/16/2022	350	0,28
	550	UBS Group Funding Switzerland AG, 1,500 %, due 11/30/2024	586	0,47
			2.439	1,97
Großbritannien – 5,28 % (28. Februar 2019: 6,26 %)				
	373	Aviva Plc, 6,125 %, due 7/5/2043 *	440	0,35
	100	Aviva Plc, 3,375 %, due 12/4/2045 *	109	0,09
	680	BP Capital Markets Plc, 0,900 %, due 7/3/2024	715	0,58
	390	Informa Plc, 1,500 %, due 7/5/2023	409	0,33
	360	Leeds Building Society, 0,125 %, due 4/21/2020	361	0,29
	270	Leeds Building Society, 1,375 %, due 5/5/2022	280	0,22
	1.110	Lloyds Banking Group Plc 0,444 %, due 6/21/2024 *	1.100	0,89
	420	Rentokil Initial Plc, 0,950 %, due 11/22/2024	438	0,35
	290	Rolls-Royce Plc, 0,875 %, due 5/9/2024	301	0,24
	260	Rolls-Royce Plc, 1,625 %, due 5/9/2028	285	0,23
	530	Royal Bank of Scotland Group Plc, 2,500 %, due 3/22/2023	567	0,46
USD	280	Standard Chartered Plc, 3,950 %, due 1/11/2023	260	0,21
	580	Standard Chartered Plc, 3,125 %, due 11/19/2024	653	0,53
	100	Wellcome Trust Ltd/The, 1,125 %, due 1/21/2027	109	0,09
	500	Yorkshire Building Society, 1,250 %, due 3/17/2022	516	0,42
			6.543	5,28
USA – 9,16 % (28. Februar 2019: 9,93 %)				
	430	Allergan Funding SCS, 1,250 %, due 6/1/2024	451	0,36
	340	American Express Credit Corp, 0,625 %, due 11/22/2021	347	0,28
	220	AT&T Inc, 3,550 %, due 12/17/2032	285	0,23
	720	Bank of America Corp, 1,379 %, due 2/7/2025 *	764	0,62
	250	Becton Dickinson and Co, 1,000 %, due 12/15/2022	258	0,21
	420	Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, due 3/16/2027	455	0,37
USD	50	Chesapeake Energy Corp, 6,625 %, due 8/15/2020	46	0,04
	390	Citigroup Inc, 0,418 %, due 5/24/2021 *	395	0,32
	790	Citigroup Inc, 1,750 %, due 1/28/2025	864	0,70
USD	260	CSC Holdings LLC, 144A, 5,375 %, due 7/15/2023	244	0,20
USD	260	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, due 3/15/2043	217	0,17
	1.200	General Electric Co, 0,375 %, due 5/17/2022	1.184	0,95
	520	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, due 7/27/2023	560	0,45
	540	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,125 %, due 9/30/2024	594	0,48

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) EUR	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
680	Goldman Sachs Group Inc/ The, 2,000 %, due 11/1/2028	768	0,62
580	John Deere Bank SA, 0,000 %, due 10/3/2022 *	581	0,47
380	Medtronic Global Holdings SCA, 1,125 %, due 3/7/2027	407	0,33
USD 120	Netflix Inc, 5,375 %, due 2/1/2021	113	0,09
USD 120	Netflix Inc, 5,500 %, due 2/15/2022	117	0,09
450	Prologis Euro Finance LLC, 1,875 %, due 1/5/2029	512	0,41
USD 50	T-Mobile USA Inc, 4,000 %, due 4/15/2022	47	0,04
USD 240	United Rentals North America Inc, 4,625 %, due 7/15/2023	224	0,18
930	Wells Fargo & Co, 0,244 %, due 4/26/2021 *	937	0,75
390	Wells Fargo & Co, 2,250 %, due 5/2/2023	424	0,34
450	Wells Fargo & Co, 1,625 %, due 6/2/2025	492	0,40
USD 70	WPX Energy Inc, 8,250 %, due 8/1/2023	71	0,06
		11.357	9,16
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten EUR 55.827)		59.126	47,68
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 49,63 % (28. Februar 2019: 50,46 %)			
Belgien – 4,96 % (28. Februar 2019: 4,30 %)			
3.330	Königreich Belgien Government Bond, Serie 71, 3,750 %, due 6/22/2045	6.151	4,96
China – 0,48 % (28. Februar 2019: 0,51 %)			
590	Export-Import Bank of China/ The, 0,300 %, due 3/6/2022	598	0,48
Frankreich – 7,69 % (28. Februar 2019: 5,64 %)			
2.715	French Republic Government Bond OAT, Serie OATe, 1,850 %, due 7/25/2027	3.447	2,78
2.275	French Republic Government Bond OAT, 3,250 %, due 5/25/2045	3.969	3,20
1.800	UNEDIC ASSEO, 1,250 %, due 5/25/2033	2.120	1,71
		9.536	7,69
Deutschland – 0,53 % (28. Februar 2019: 12,38 %)			
590	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, due 2/15/2028	657	0,53
Indonesien – 0,20 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
240	Indonesia Government International Bond, 1,450 %, due 9/18/2026	252	0,20
Italien – 13,88 % (28. Februar 2019: 17,70 %)			
4.720	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4,500 %, due 3/1/2024	5.588	4,51
5.030	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,000 %, due 12/1/2025	5.461	4,40
639	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 2,550 %, due 9/15/2041 β	847	0,68
4.155	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250 %, due 9/1/2046	5.317	4,29
		17.213	13,88
Mexiko – 0,99 % (28. Februar 2019: 0,50 %)			
580	Mexico Government International Bond, 1,375 %, due 1/15/2025	610	0,49
580	Mexico Government International Bond, 1,750 %, due 4/17/2028	612	0,50
		1.222	0,99
Polen – 3,70 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
PLN 18.660	Republik Polen Government Bond, Serie 0428, 2,750 %, due 4/25/2028	4.589	3,70
Saudi-Arabien – 0,58 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
640	Saudi Government International Bond, 2,000 %, due 7/9/2039	723	0,58
Südkorea – 1,61 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
1.150	Export-Import Bank of Korea, 0,375 %, due 3/26/2024	1.187	0,96
790	Korea Development Bank/ The, 0,000 %, due 7/10/2024	803	0,65
		1.990	1,61
Spanien – 9,13 % (28. Februar 2019: 8,15 %)			
4.280	Spain Government Bond, 0,450 %, due 10/31/2022	4.411	3,56
2.070	Spain Government Bond, 144A, 1,300 %, due 10/31/2026	2.288	1,84
790	Spain Government Bond, 144A, 1,400 %, due 4/30/2028	888	0,72
1.830	Spain Government Bond, 144A, 2,900 %, due 10/31/2046	2.689	2,17
730	Spain Government Bond, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, due 10/31/2048	1.046	0,84
		11.322	9,13
Schweden – 1,34 % (28. Februar 2019: 1,28 %)			
SEK 10.700	Sweden Government Bond, Serie 1053, 3,500 %, due 3/30/2039	1.659	1,34
USA – 4,54 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
USD 4.184	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, due 4/15/2024	3.887	3,13
USD 1.590	United States Treasury Note/ Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	1.743	1,41
		5.630	4,54
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten EUR 54.977)		61.542	49,63
Investmentfonds - 0,28 % (28. Februar 2019: 0,23 %)			
USD 380	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	346	0,28
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten EUR 342)		346	0,28
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten EUR 111.146)		121.014	97,59

Kontrakte (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) EUR	% des Nettoinventarwerts
Gekaufte Optionen – 0,01 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
	– Euro-BPT Future November 2019 Put 136,50, due 10/25/2019	13	0,01
Gekaufte Optionen insgesamt (Anschaffungskosten EUR 16)		13	0,01
Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2019: 0,03 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		11	0,01
Futures – 0,21 % (28. Februar 2019: 0,04 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		254	0,21
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		121.292	97,82
Verkaufte Optionen – (0,22 %) (28. Februar 2019: 0,04 %)			
	– Euro-BPT Future November 2019 Call 145,00, due 10/25/2019	(24)	(0,02)
	– Euro-Bund October 2019 Put 174,00, due 9/20/2019	(4)	–
USD	– IMM Euro$ Dezember 2019 Call 97,25, due 12/16/2019	(103)	(0,08)
USD	– U.S. 10 Year October 2019 Call 130,00, due 9/20/2019	(143)	(0,12)
Veräußerte Optionen gesamt (Anschaffungskosten EUR (122))		(274)	(0,22)
Credit Default Swaps – (0,09 %) (28. Februar 2019: (0,07 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(110)	(0,09)
Devisenterminkontrakte – (0,16 %) (28. Februar 2019: (0,02 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(192)	(0,16)
Futures – (0,65 %) (28. Februar 2019: 0,51 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(803)	(0,65)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		(1.379)	(1,12)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten		119.913	96,70
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		4.084	3,30
Gesamtnettovermögen		EUR 23.997	100,00

– Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf EUR 0 oder weniger als EUR 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %,

144A Von der Registrierung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 31. August 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf EUR 13.441.000 oder 10,84 % des Nettovermögens.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen

PLN – Polnischer Zloty

SEK – Schwedische Krone

USD – US-Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,10
Investmentfonds	0,28
Derivate	0,22
Sonstige Vermögenswerte	3,40
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kaufs-/Verkaufs-sicherung	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 %	Kauf	20.6.24	4.450	EUR (110)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR –)					EUR –
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR (82))					(110)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR (82))					EUR (110)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht Realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
21.11.19	BNP Paribas	Kauf	EUR	645	Verkauf	SEK	6.930	EUR	3
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	400	Verkauf	EUR	358		3
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	PLN	467	Verkauf	EUR	107		(1)
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	NOK	11.030	Verkauf	EUR	1.096		1
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	EUR	7.784	Verkauf	USD	8.785		(160)
21.11.19	JP Morgan	Kauf	EUR	583	Verkauf	GBP	540		(13)
21.11.19	UBS	Kauf	USD	200	Verkauf	EUR	177		4
21.11.19	UBS	Kauf	SEK	14.381	Verkauf	EUR	1.339		(7)
21.11.19	UBS	Kauf	EUR	704	Verkauf	USD	790		(11)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR 36)									11
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR (28))									(192)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR 8)								EUR	(181)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro$ December 2019	(15)	EUR (3.348)	EUR (30)
Euro-Bobl September 2019	(79)	(10.762)	(198)
Euro-BTP September 2019	10	1.453	76
Euro-Bund December 2019	(22)	(3.878)	–
Euro-Bund September 2019	(18)	(3.224)	(116)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2019	3	673	56
Euro-OAT September 2019	(50)	(8.520)	(402)
Long Gilt December 2019	(48)	(7.136)	(27)
U.S. 10 Year Note (CBT) December 2019	(35)	(4.195)	(17)
U.S. 10 Year Ultra Note December 2019	137	18.005	62
U.S. 5 Year Note (CBT) December 2019	(48)	(5.240)	(13)
U.S. Long Bond (CBT) December 2019	18	2.706	21
U.S. Ultra Bond (CBT) December 2019	20	3.593	39
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR 45)			EUR 254
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR (578))			(803)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR (533))			EUR (549)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Asset-Backed Securities - 0,55 % (28. Februar 2019: 0,55 %)			
116	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Klasse 3A4, 5,860 %, due 1/25/2037	117	0,55
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 112)		117	0,55
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 5,69 % (28. Februar 2019: 5,50 %)			
123	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Serie 2004 AR1, Klasse 6M2, 3,745 %, due 2/25/2034 *	126	0,59
260	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 DNA3, Klasse B1, 6,595 %, due 3/25/2030 *	288	1,36
54	Impac CMB Trust Serie 2004-6, Serie 2004 6, Klasse 2A, 6,060 %, due 10/25/2034	61	0,29
273	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2004-AR7, Serie 2004 AR7, Klasse A2, 3,005 %, due 9/25/2034 *	268	1,27
175	Lehman XS Trust Serie 2006-12N, Serie 2006 12N, Klasse A31A, 2,345 %, due 8/25/2046 *	166	0,78
67	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Serie 2003-A1, Serie 2003 A1, Klasse M, 6,584 %, due 5/25/2033 *	70	0,33
115	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Serie 2005 8XS, Klasse M1, 2,790 %, due 4/25/2035 *	111	0,52
162	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR15 Trust, Serie 2005 AR15, Klasse A1C4, 2,545 %, due 11/25/2045 *	116	0,55
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 1.108).		1206	5,69
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 78,22 % (28. Februar 2019: 78,43 %)			
Brasilien – 0,26 % (28. Februar 2019: 0,51 %)			
31	Petrobras Global Finance BV, 6,125 %, due 1/17/2022	34	0,16
20	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, due 3/17/2024	22	0,10
		56	0,26
Kanada – 2,46 % (28. Februar 2019: 2,93 %)			
90	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 4,625 %, due 1/15/2022	91	0,43
50	Cott Holdings Inc, 5,500 %, due 4/1/2025	52	0,25
120	GFL Environmental Inc, 5,375 %, due 3/1/2023	121	0,57
170	Hudbay Minerals Inc, 7,250 %, due 1/15/2023	176	0,83
80	MEG Energy Corp, 6,500 %, due 1/15/2025	81	0,38
		521	2,46
Kaimaninseln – 0,81 % (28. Februar 2019: 0,01 %)			
1	Ambac LSNI LLC, 144A, 7,319 %, due 2/12/2023 *	1	0,01
170	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6,500 %, due 9/15/2024	170	0,80
		171	0,81
Frankreich – 0,98 % (28. Februar 2019: 1,94 %)			
200	Altice France SA/France, Serie REgS, 6,250 %, due 5/15/2024	207	0,98
Deutschland – 0,19 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
38	Mercer International Inc, 7,750 %, due 12/1/2022	39	0,19
Irland – 0,99 % (28. Februar 2019: 2,14 %)			
200	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 6,000 %, due 2/15/2025	209	0,99
Israel – 0,31 % (28. Februar 2019: 0,36 %)			
70	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200 %, due 7/21/2021	66	0,31
Luxemburg – 2,10 % (28. Februar 2019: 3,11 %)			
228	ARD Securities Finance SARL, 8,750 %, due 1/31/2023	237	1,12
200	Intelsat Jackson Holdings SA, 8,000 %, due 2/15/2024	209	0,98
		446	2,10
Macau – 0,98 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
200	MGM China Holdings Ltd, 5,375 %, due 5/15/2024	206	0,98
Niederlande – 1,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
200	Trivium Packaging Finance BV, 5,500 %, due 8/15/2026	212	1,00
Vereinigte Arabische Emirate – 1,09 % (28. Februar 2019: 1,01 %)			
130	DAE Funding LLC, 4,500 %, due 8/1/2022	133	0,63
110	Shelf Drilling Holdings Ltd, 8,250 %, due 2/15/2025	98	0,46
		231	1,09
Großbritannien – 3,20 % (28. Februar 2019: 3,67 %)			
200	Barclays Bank Plc, 7,625 %, due 11/21/2022	221	1,04
EUR 200	Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual *	235	1,11
210	Royal Bank of Scotland Group Plc, 8,625 %, Perpetual *	223	1,05
		679	3,20
USA – 62,96 % (28. Februar 2019: 61,90 %)			
180	ADT Security Corp/The, 4,125 %, due 6/15/2023	183	0,87
40	AES Corp/VA, 4,875 %, due 5/15/2023	41	0,19
400	Alcoa Nederland Holding BV, 6,750 %, due 9/30/2024	421	1,99
130	Ally Financial Inc, 7,500 %, due 9/15/2020	137	0,65
–	Ambac Assurance Corp, 144A, 5,100 %, due 6/7/2020	–	–
40	American Axle & Manufacturing Inc, 6,625 %, due 10/15/2022	40	0,19
40	American Axle & Manufacturing Inc, 6,250 %, due 4/1/2025	38	0,18
100	Antero Resources Corp, 5,000 %, due 3/1/2025	87	0,41
150	Axalta Coating Systems LLC, 4,875 %, due 8/15/2024	156	0,74
50	Bausch Health Cos Inc, 6,500 %, due 3/15/2022	52	0,24
170	Bausch Health Cos Inc, 7,000 %, due 3/15/2024	180	0,85
140	Bausch Health Cos Inc, 6,125 %, due 4/15/2025	145	0,68
90	Berry Petroleum Co LLC, 7,000 %, due 2/15/2026	83	0,39
180	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 6,125 %, due 11/15/2022	182	0,86
40	Carrizo Oil & Gas Inc, 8,250 %, due 7/15/2025	39	0,18
320	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 5,375 %, due 5/1/2025	333	1,57
130	Centene Corp, 6,125 %, due 2/15/2024	136	0,64
120	Centene Corp, 4,750 %, due 1/15/2025	125	0,59
50	CenturyLink Inc, Serie V, 5,625 %, due 4/1/2020	51	0,24
20	CenturyLink Inc, Serie W, 6,750 %, due 12/1/2023	22	0,10
90	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, due 7/23/2025	100	0,47
20	Cheniere Energy Inc, 4,250 %, due 3/15/2045	16	0,07
150	Chesapeake Energy Corp, 7,000 %, due 10/1/2024	115	0,54
70	Chesapeake Energy Corp, 8,000 %, due 6/15/2027	51	0,24
70	CIT Group Inc, 4,125 %, due 3/9/2021	72	0,34
140	CIT Group Inc, 4,750 %, due 2/16/2024	151	0,71
70	Citigroup Inc, Serie D, 5,350 %, Perpetual *	72	0,34
60	Citigroup Inc, Serie M, 6,300 %, Perpetual *	64	0,30
180	Cleaver-Brooks Inc, 7,875 %, due 3/1/2023	166	0,78
120	Cogent Communications Group Inc, 5,375 %, due 3/1/2022	125	0,59
110	CoreCivic Inc, 4,125 %, due 4/1/2020	110	0,52
50	Covanta Holding Corp, 5,875 %, due 7/1/2025	52	0,25
200	CSC Holdings LLC, 5,375 %, due 7/15/2023	206	0,97
60	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 5,250 %, due 6/1/2025	62	0,29
60	DaVita Inc, 5,000 %, due 5/1/2025	60	0,28
130	DCP Midstream Operating LP, 4,950 %, due 4/1/2022	135	0,64
50	Dell International LLC / EMC Corp, 5,875 %, due 6/15/2021	51	0,24
7	Delta Air Lines 2007-1 Klasse B Pass Through Trust, Serie 071B, 8,021 %, due 8/10/2022	8	0,04
110	Diamondback Energy Inc, 4,750 %, due 11/1/2024	114	0,54
290	DISH DBS Corp, 5,875 %, due 11/15/2024	277	1,31
180	DISH DBS Corp, 7,750 %, due 7/1/2026	177	0,84
70	Donnelley Financial Solutions Inc, 8,250 %, due 10/15/2024	73	0,34
90	EMC Corp, 2,650 %, due 6/1/2020	90	0,42
50	Exterran Energy Solutions LP / EES Finance Corp, 8,125 %, due 5/1/2025	50	0,24
170	Extraction Oil & Gas Inc, 7,375 %, due 5/15/2024	128	0,61
110	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 7,875 %, due 11/15/2025	111	0,52
420	Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, due 11/14/2024	425	2,01
110	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 5,625 %, due 6/15/2024	106	0,50
110	GEO Group Inc/The, 5,875 %, due 10/15/2024	97	0,46
20	GEO Group Inc/The, 6,000 %, due 4/15/2026	17	0,08
100	Golden Nugget Inc, 6,750 %, due 10/15/2024	102	0,48
50	Golden Nugget Inc, 8,750 %, due 10/1/2025	53	0,25
150	Hanesbrands Inc, 4,625 %, due 5/15/2024	158	0,74
100	HCA Inc, 5,875 %, due 5/1/2023	111	0,52
140	HCA Inc, 5,375 %, due 2/1/2025	156	0,74
30	Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp, 6,000 %, due 8/1/2024	32	0,15
200	International Game Technology Plc, 6,250 %, due 2/15/2022	212	1,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
90	Iron Mountain Inc, 4,375 %, due 6/1/2021	91	0,43
70	j2 Cloud Services LLC / j2 Global Co-Obligor Inc, 6,000 %, due 7/15/2025	74	0,35
26	Kinetic Concepts Inc / KCI USA Inc, 7,875 %, due 2/15/2021	27	0,13
210	L Brands Inc, 5,625 %, due 10/15/2023	222	1,05
120	Lamb Weston Holdings Inc, 4,625 %, due 11/1/2024	126	0,59
43	Lehman Escrow Receipt, zero coupon, Perpetual †∞	1	–
100	Lennar Corp, 4,875 %, due 12/15/2023	108	0,51
120	Lennar Corp, 4,500 %, due 4/30/2024	128	0,60
50	Levi Strauss & Co, 5,000 %, due 5/1/2025	52	0,25
100	Lions Gate Capital Holdings LLC, 6,375 %, due 2/1/2024	106	0,50
180	Match Group Inc, 6,375 %, due 6/1/2024	190	0,90
170	MGM Resorts International, 6,000 %, due 3/15/2023	187	0,88
230	Montage Resources Corp, 8,875 %, due 7/15/2023	174	0,82
30	Murphy Oil USA Inc, 6,000 %, due 8/15/2023	31	0,15
40	Murphy Oil USA Inc, 5,625 %, due 5/1/2027	42	0,20
114	Murray Energy Corp, 12,000 %, due 4/15/2024	11	0,05
200	Navient Corp, 8,000 %, due 3/25/2020	206	0,97
50	Navient Corp, 6,500 %, due 6/15/2022	54	0,26
130	Navios Maritime Acquisition Corp / Navios Acquisition Finance US Inc, 8,125 %, due 11/15/2021	106	0,50
76	NCL Corp Ltd, 4,750 %, due 12/15/2021	77	0,36
140	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp, 7,500 %, due 11/1/2023	142	0,67
110	Northern Oil and Gas Inc, 8,500 %, due 5/15/2023	114	0,54
80	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, due 3/15/2022	75	0,35
90	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, due 1/15/2023	82	0,39
75	Pactiv LLC, 8,375 %, due 4/15/2027	81	0,38
70	Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, due 4/15/2027	68	0,32
50	PQ Corp, 6,750 %, due 11/15/2022	52	0,25
74	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 9,250 %, due 5/15/2023	78	0,37
20	Pyxus International Inc, 9,875 %, due 7/15/2021	16	0,07
70	QEP Resources Inc, 6,875 %, due 3/1/2021	70	0,33
130	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc, 8,250 %, due 5/1/2023	139	0,66
120	Resolute Forest Products Inc, 5,875 %, due 5/15/2023	120	0,57
310	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu, 5,803 %, due 7/15/2021 *	310	1,46
210	Rockies Express Pipeline LLC, 5,625 %, due 4/15/2020	215	1,02
158	Scientific Games International Inc, 10,000 %, due 12/1/2022	165	0,78
150	Seagate HDD Cayman, 4,875 %, due 3/1/2024	157	0,74
200	Service Corp International/US, 5,375 %, due 5/15/2024	207	0,98
40	Silversea Cruise Finance Ltd, 7,250 %, due 2/1/2025	43	0,20
100	Speedway Motorsports Inc, 5,125 %, due 2/1/2023	102	0,48
160	Sprint Communications Inc, 7,000 %, due 8/15/2020	166	0,79
200	Sprint Communications Inc, 11,500 %, due 11/15/2021	235	1,11
50	Sprint Communications Inc, 6,000 %, due 11/15/2022	53	0,25
125	Sprint Corp, 7,875 %, due 9/15/2023	141	0,67
160	Sprint Corp, 7,125 %, due 6/15/2024	177	0,84
100	Standard Industries Inc/NJ, 5,375 %, due 11/15/2024	103	0,49
30	Suburban Propane Partners LP/ Suburban Energy Finance Corp, 5,875 %, due 3/1/2027	30	0,14
70	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,250 %, due 11/15/2023	70	0,33
10	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,125 %, due 2/1/2025	10	0,05
210	Tenet Healthcare Corp, 6,750 %, due 6/15/2023	217	1,02
110	T-Mobile USA Inc, 6,000 %, due 4/15/2024	115	0,54
80	Transocean Guardian Ltd, 5,875 %, due 1/15/2024	81	0,38
50	United Airlines Holdings Inc, 4,250 %, due 10/1/2022	52	0,24
90	United Rentals North America Inc, 4,625 %, due 7/15/2023	92	0,44
30	United Rentals North America Inc, 4,625 %, due 10/15/2025	31	0,15
60	United Rentals North America Inc, 6,500 %, due 12/15/2026	65	0,31
180	Valvoline Inc, 5,500 %, due 7/15/2024	188	0,89
220	Viking Cruises Ltd, 6,250 %, due 5/15/2025	229	1,08
70	Whiting Petroleum Corp, 5,750 %, due 3/15/2021	66	0,31
100	William Lyon Homes Inc, 6,000 %, due 9/1/2023	104	0,49
40	William Lyon Homes Inc, 5,875 %, due 1/31/2025	41	0,19
20	Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, due 1/15/2031	27	0,13
10	WPX Energy Inc, 6,000 %, due 1/15/2022	10	0,05
160	WPX Energy Inc, 8,250 %, due 8/1/2023	179	0,84
50	WPX Energy Inc, 5,750 %, due 6/1/2026	52	0,25
		13.339	62,96
Sambia – 0,89 % (28. February 2019: 0,85 %)			
200	First Quantum Minerals Ltd, 7,250 %, due 4/1/2023	189	0,89
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 16.532)		16.571	78,22
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,40 % (28. Februar 2019: 0,81 %)			
Argentinien – 0,40 % (28. Februar 2019: 0,81 %)			
210	Argentine Republic Government International Bond, 5,625 %, due 1/26/2022	84	0,40
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 189)		84	0,40
Schuldscheindarlehen – 8,68 % (28. Februar 2019: 9,88 %)			
51	Academy Ltd, 6,230 %, due 7/2/2022 *	34	0,16
39	Advantage Sales & Marketing Inc, 5,580 %, due 7/25/2021 *	36	0,17
108	Air Medical Group Holdings Inc, 5,432 %, due 4/28/2022 *	102	0,48
80	Albertson's LLC, 5,234 %, due 8/7/2026 *	80	0,38
46	Avolon TLB Borrower 1 U.S. LLC, 4,021 %, due 1/15/2025 *	47	0,22
79	BCP Renaissance Parent LLC, 5,756 %, due 10/31/2024 *	76	0,36
70	Beta Sub LLC, 6,729 %, due 5/24/2026 *	70	0,33
45	Boyd Gaming Corp, 4,392 %, due 9/15/2023 *	45	0,21
170	Census Technologies Inc, 0,000 %, due 9/28/2022 *∞	167	0,79
118	CenturyLink Inc, 4,984 %, due 1/31/2025 *	117	0,55
50	DCert Buyer Inc, 0,000 %, due 8/8/2026 *	50	0,24
20	Diamond Sports Group LLC, 5,420 %, due 7/18/2026 *	20	0,09
20	Drive Chassis Holdco LLC, 10,588 %, due 4/12/2026 *	19	0,09
107	Four Seasons Hotels Ltd, 4,234 %, due 11/30/2023 *	107	0,51
16	GlobalTranz Enterprises Inc, 7,182 %, due 5/2/2026 *	15	0,07
4	GlobalTranz Enterprises Inc, 0,000 %, due 5/2/2026 *	4	0,02
10	iHeartCommunications Inc, 6,230 %, due 5/1/2026 *	10	0,05
132	Jo-Ann Stores LLC, 7,259 %, due 10/16/2023 *	103	0,48
134	Leslie's Poolmart Inc, 5,758 %, due 8/16/2023 *	126	0,60
10	Nascar Holdings Inc, 0,000 %, due 7/26/2026 *	10	0,05
50	Panther BF Aggregator 2 LP, 5,734 %, due 3/18/2026 *	49	0,23
80	PetSmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022 *	77	0,37
79	Pisces Midco Inc, 5,951 %, due 3/29/2025 *	77	0,36
40	RegionalCare Hospital Partners Holding, 6,769 %, due 11/16/2025 *	40	0,19
97	Reynolds Group Holdings Inc, 4,984 %, due 2/5/2023 *	97	0,46
31	Sally Holdings LLC, 4,490 %, due 7/5/2024 *	30	0,14
59	Scientific Games International Inc, 4,984 %, due 8/14/2024 *	59	0,28
20	Spencer Spirit IH LLC, 8,182 %, due 6/14/2026 *	20	0,09
40	U.S. Renal Care Inc, 7,250 %, due 6/14/2026 *	38	0,18
45	Univision Communications Inc, 4,984 %, due 3/15/2024 *	43	0,20
70	World Triathlon Corp, 6,445 %, due 8/12/2026 *	70	0,33
Loan Notes insgesamt (Anschaffungskosten USD 1.912)		1.838	8,68
Termineinlagen – 1,89 % (28. Februar 2019: 1,30 %)			
401	Barclays Capital London, 2,080 %, due 9/3/2019	401	1,89
Termineinlagen insgesamt (Anschaffungskosten USD 401)		401	1,89
Stammaktien – 0,04 % (28. Februar 2019: 0,20 %)			
USA – 0,04 % (28. Februar 2019: 0,20 %)			
–	Berry Petroleum Corp	2	0,01
2	Montage Resources Corp	6	0,03
		8	0,04
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 71)		8	0,04
Vorzugsaktien – 1,11 % (28. Februar 2019: 1,01 %)			
USA – 1,11 % (28. Februar 2019: 1,01 %)			
1	B. Riley Financial Inc †	26	0,12
8	GMAC Capital Trust I, Series 2	210	0,99
		236	1,11
Vorzugsaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 221)		236	1,11
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 20.546)		20.461	96,58
Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		4	0,02

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Futures – 0,01 % (28. Februar 2019: 0,04 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1	0,01
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		20.466	96,61
Devisenterminkontrakte – (0,09 %) (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(18)	(0,09)
Futures – (0,01 %) (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(1)	(0,01)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		(19)	(0,10)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		20.447	96,51
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		739	3,49
Nettovermögen insgesamt	USD	21.186	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf USD 0, weniger als USD 1.000, 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 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 1,000 und machten 0,01 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

† Illiquide.

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

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen

EUR – Euro

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	84,92
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	8,57
Einlagen bei Kreditinstituten	1,87
Derivate	0,02
Sonstige Vermögenswerte	4,62
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	AUD	1	USD	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	773	Verkauf	USD	868		(18)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	104	Verkauf	USD	71		–
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	248	Verkauf	EUR	220		4
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 1)									4
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)									(18)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 1)								USD	(14)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
U.S. 5 Year Note (CBT) December 2019	6	USD 720	USD	1
U.S. Ultra Bond (CBT) December 2019	(4)	(790)		(1)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 10)			USD	1
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)				(1)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 10)			USD	–

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Asset-Backed Securities - 0,37 % (28. Februar 2019: 0,34 %)			
2.719	HSI Asset Securitization Corp Trust 2007-OPT1, Serie 2007 OPT1, Klasse 1A, 2,285 %, due 12/25/2036 *	2.438	0,37
Asset-Backed Securities insgesamt (Anschaffungskosten USD 2.113)		2.438	0,37
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 4,45 % (28. Februar 2019: 5,27 %)			
513	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Serie 2006-C5, Serie 2006 C5, Klasse AJ, 5,373 %, due 12/15/2039	348	0,05
483	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Serie 2007-C5, Serie 2007 C5, Klasse AM, 5,869 %, due 9/15/2040 *	367	0,06
3.101	CSMC Serie 2015-2R, Serie 2015 2R, Klasse 7A2, 144A, 3,843 %, due 8/27/2036 *	2.654	0,41
1.622	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2015 C03, Klasse 2M2, 7,145 %, due 7/25/2025 *	1.699	0,26
3.230	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C01, Klasse 1M2, 5,816 %, due 7/25/2029 *	3.379	0,52
968	GMACM Mortgage Loan Trust 2005-AF2, Serie 2005 AF2, Klasse A1, 6,000 %, due 12/25/2035	960	0,15
2.722	Impac Secured Assets Trust 2006-2, Serie 2006 2, Klasse 2M3, 3,245 %, due 8/25/2036 *	2.758	0,42
5.300	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Klasse M, 144A, 10,403 %, due 6/15/2035 *	5.289	0,81
899	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-CIBC19, Serie 2007 CB19, Klasse AJ, 6,004 %, due 2/12/2049 *	603	0,09
18	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP 12. Ser ies 2007 LD12. Klasse AJ, 6,613 %, due 2/15/2051 *	17	–
4.778	Lone Star Portfolio Trust 2015-LSP, Serie 2015 LSP, Klasse F, 144A, 9,345 %, due 9/15/2028 *	4.803	0,73
2.003	Lone Star Portfolio Trust, Serie 2015 LSMZ, Klasse M, 144A, 9,413 %, due 9/15/2020 *	1.996	0,30
1.850	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-1, Serie 2017 1, Klasse M1, 144A, 4,000 %, due 1/25/2056 *	1.881	0,29
3.227	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR17 Trust, Serie 2005 AR17, Klasse A1C3, 2,625 %, due 12/25/2045 *	2.379	0,36
Mortgage-Backed Securities insgesamt (Anschaffungskosten USD 29.104)		29.133	4,45

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 43,45 % (28. Februar 2019: 42,92 %)			
Argentinien – 0,39 % (28. Februar 2019: 0,84 %)			
4.000	Pampa Energia SA, 7,500 %, due 1/24/2027	2.560	0,39
ARS 400	YPF SA, 16,500 %, due 5/9/2022	3	–
		2.563	0,39
Belgien – 0,39 % (28. Februar 2019: 0,34 %)			
2.090	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev NV Worldwide Inc, 4,900 %, due 2/1/2046	2.495	0,38
40	Anheuser-Busch InBev NV Worldwide Inc, 4,439 %, due 10/6/2048	46	0,01
		2.541	0,39
Brasilien – 3,74 % (28. Februar 2019: 3,21 %)			
2.910	Braskem America Finance Co, 7,125 %, due 7/22/2041	3.481	0,53
211	Braskem Finance Ltd, 7,000 %, due 5/7/2020	217	0,03
1.710	Braskem Finance Ltd, 5,375 %, due 5/2/2022	1.788	0,27
3.820	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 6,125 %, Perpetual *	3.858	0,59
7.194	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, due 3/17/2024	8.023	1,23
1.310	Suzano Austria GmbH, 5,750 %, due 7/14/2026	1.466	0,23
2.170	Ultrapar International SA, 144A, 5,250 %, due 10/6/2026	2.308	0,35
2.880	Vale Overseas Ltd, 6,250 %, due 8/10/2026	3.332	0,51
		24.473	3,74
Kanada – 0,83 % (28. Februar 2019: 0,45 %)			
GBP 390	Entertainment One Ltd, 4,625 %, due 7/15/2026	518	0,08
2.980	Hudbay Minerals Inc, 144A, 7,625 %, due 1/15/2025	3.039	0,46
1.890	MEG Energy Corp, 144A, 7,000 %, due 3/31/2024	1.807	0,28
100	MEG Energy Corp, 144A, 6,500 %, due 1/15/2025	101	0,01
		5.465	0,83
Chile – 0,06 % (28. Februar 2019: 0,05 %)			
368	AES Gener SA, 5,250 %, due 8/15/2021	384	0,06
Kolumbien – 0,59 % (28. Februar 2019: 1,16 %)			
3.680	Millicom International Cellular SA, 5,125 %, due 1/15/2028	3.841	0,59
Dänemark – 0,27 % (28. Februar 2019: 0,24 %)			
EUR 1.550	Danske Bank A/S, 5,750 %, Perpetual *	1.739	0,27
Frankreich – 0,15 % (28. Februar 2019: 0,92 %)			
EUR 810	Credit Agricole SA, 6,500 %, Perpetual *	964	0,15
Irland – 1,37 % (28. Februar 2019: 1,29 %)			
3.300	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 6,000 %, due 2/15/2025	3.455	0,53
1.420	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,250 %, due 8/15/2022	1.504	0,23
1.140	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 4,500 %, due 3/15/2023	1.182	0,18
2.590	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, due 2/15/2024	2.804	0,43
		8.945	1,37

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Italien – 1,39 % (28. Februar 2019: 1,17 %)			
EUR 1.750	Intesa Sanpaolo SpA, 7,000 %, Perpetual *	2.045	0,31
EUR 1.880	Telecom Italia Finance SA, 7,750 %, due 1/24/2033	3.088	0,47
EUR 3.480	UniCredit SpA, 6,625 %, Perpetual *	3.979	0,61
		9.112	1,39
Jersey – 0,04 % (28. Februar 2019: 0,03 %)			
EUR 220	LHC3 Plc, 4,125 %, due 8/15/2024	251	0,04
Kasachstan – 0,65 % (28. Februar 2019: 0,74 %)			
790	KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, due 4/24/2030	918	0,14
3.150	KazTransGas JSC, 4,375 %, due 9/26/2027	3.328	0,51
		4.246	0,65
Luxemburg – 0,27 % (28. Februar 2019: 0,53 %)			
702	Altice Luxembourg SA, 144A, 7,750 %, due 5/15/2022	722	0,11
EUR 946	Monitchem HoldCo 2 SA, 6,875 %, due 6/15/2022	1.056	0,16
		1.778	0,27
Macau – 0,21 % (28. Februar 2019: 0,18 %)			
1.300	Sands China Ltd, 4,600 %, due 8/8/2023	1.386	0,21
Mexiko – 1,31 % (28. Februar 2019: 1,09 %)			
1.360	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 6,875 %, Perpetual *	1.352	0,21
3.280	BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, due 1/18/2033 *	3.153	0,48
3.790	Mexichem SAB de CV, 5,875 %, due 9/17/2044	4.055	0,62
		8.560	1,31
Marokko – 0,57 % (28. Februar 2019: 0,48 %)			
3.530	OCP SA, 4,500 %, due 10/22/2025	3.753	0,57
Niederlande – 2,57 % (28. Februar 2019: 2,39 %)			
EUR 1.600	Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, Perpetual *	1.940	0,30
8.120	ING Groep NV, 6,875 %, Perpetual *	8.576	1,31
EUR 1.640	Maxeda DIY Holding BV, 6,125 %, due 7/15/2022	1.772	0,27
2.470	OCI NV, 6,625 %, due 4/15/2023	2.618	0,40
1.510	Trivium Packaging Finance BV, 5,500 %, due 8/15/2026	1.601	0,24
290	UPCB Finance IV Ltd, 144A, 5,375 %, due 1/15/2025	300	0,05
		16.807	2,57
Peru – 1,61 % (28. Februar 2019: 1,30 %)			
4.050	Southern Copper Corp, 5,250 %, due 11/8/2042	4.688	0,72
5.450	Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, due 4/30/2028	5.833	0,89
		10.521	1,61
Südafrika – 0,60 % (28. Februar 2019: 0,48 %)			
200	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, due 4/10/2027	216	0,03
3.290	Myriad International Holdings BV, 4,850 %, due 7/6/2027	3.743	0,57
		3.959	0,60
Spanien – 0,39 % (28. Februar 2019: 0,58 %)			
EUR 1.930	Lecta SA, 6,500 %, due 8/1/2023	856	0,13
EUR 370	Tendam Brands SAU, 5,000 %, due 9/15/2024	416	0,07

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

	Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)				
Spanien – (Fortsetzung)				
EUR	1.130	Tendam Brands SAU, 5,250 %, due 9/15/2024 *	1.250	0,19
			2.522	0,39
Schweiz – 0,92 % (28. Februar 2019: 0,67 %)				
	720	Credit Suisse Group AG, 7,500 %, Perpetual *	767	0,12
	1.438	Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, due 11/15/2041	1.662	0,25
EUR	630	Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000 %, Perpetual *	731	0,11
	1.770	Syngenta Finance NV, 4,441 %, due 4/24/2023	1.855	0,28
	980	UBS Group Funding Switzerland AG, 7,000 %, Perpetual *	1.040	0,16
			6.055	0,92
Türkei – 0,67 % (28. Februar 2019: 0,59 %)				
	4.620	Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 4,875 %, due 6/19/2024	4.394	0,67
Vereinigte Arabische Emirate – 0,49 % (28. Februar 2019: 0,80 %)				
	20	DAE Funding LLC, 144A, 4,500 %, due 8/1/2022	21	–
	2.650	DP World Plc, 5,625 %, due 9/25/2048	3.166	0,49
			3.187	0,49
Großbritannien – 2,89 % (28. Februar 2019: 3,39 %)				
	3.640	Barclays Bank Plc, 7,625 %, due 11/21/2022	4.016	0,61
GBP	620	Barclays Plc, 7,125 %, Perpetual *	782	0,12
GBP	1.040	BUPA Finance Plc, 5,000 %, due 4/25/2023	1.390	0,21
GBP	1.459	Greene King Finance Plc, Serie B2, 2,866 %, due 3/15/2036 *	1.549	0,24
GBP	1.050	HSBC Holdings Plc, 7,000 %, due 4/7/2038	1.895	0,29
	2.550	HSBC Holdings Plc, 6,375 %, Perpetual *	2.644	0,41
EUR	1.600	Lloyds Banking Group Plc, 6,375 %, Perpetual *	1.791	0,27
GBP	2.545	Marston's Issuer Plc, Serie B1, 3,320 %, due 7/15/2035 *	2.648	0,41
GBP	1.091	Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, due 7/13/2044	1.713	0,26
	450	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, due 8/15/2026	472	0,07
			18.900	2,89
USA – 20,66 % (28. Februar 2019: 19,61 %)				
	810	Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,750 %, due 9/30/2024	853	0,13
	2.540	Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 7,000 %, due 9/30/2026	2.749	0,42
	1.550	Allergan Funding SCS, 4,850 %, due 6/15/2044	1.702	0,26
	990	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp, 6,375 %, due 5/1/2024	1.042	0,16
	400	Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, due 4/1/2026	454	0,07
	250	Bausch Health Cos Inc, 144A, 9,000 %, due 12/15/2025	281	0,04
	1.500	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,125 %, due 11/15/2022	1.515	0,23
	280	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,375 %, due 5/1/2025	292	0,04
	850	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,750 %, due 2/15/2026	902	0,14
	2.380	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, due 5/1/2027	2.523	0,39
	1.710	Celgene Corp, 5,000 %, due 8/15/2045	2.172	0,33
	3.030	Centene Corp, 4,750 %, due 5/15/2022	3.116	0,48
	880	CenturyLink Inc, Serie W, 6,750 %, due 12/1/2023	956	0,15
	2.794	Chesapeake Energy Corp, 8,000 %, due 6/15/2027	2.033	0,31
	3.000	Citigroup Inc, 4,450 %, due 9/29/2027	3.303	0,50
	320	Comcast Corp, 3,600 %, due 3/1/2024	341	0,05
	1.900	Comcast Corp, 4,700 %, due 10/15/2048	2.384	0,36
	600	Comcast Corp, 4,950 %, due 10/15/2058	783	0,12
	1.758	Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, due 6/1/2044	1.773	0,27
	6.060	CVS Health Corp, 4,100 %, due 3/25/2025	6.491	0,99
	2.600	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 5,875 %, due 6/15/2021	2.644	0,40
	1.500	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 7,125 %, due 6/15/2024	1.581	0,24
	1.270	Delphi Technologies Plc, 144A, 5,000 %, due 10/1/2025	1.102	0,17
	370	Delta Air Lines 2007-1 Klasse B Pass Through Trust, Serie 071B, 8,021 %, due 8/10/2022	412	0,06
	2.275	DISH DBS Corp, 5,875 %, due 7/15/2022	2.363	0,36
	1.620	DISH DBS Corp, 5,875 %, due 11/15/2024	1.547	0,24
	2.250	DISH DBS Corp, 7,750 %, due 7/1/2026	2.216	0,34
	200	El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, due 6/15/2032	281	0,04
	970	Energy Transfer Partners LP / Regency Energy Finance Corp, 5,875 %, due 3/1/2022	1.041	0,16
	580	Energy Transfer Partners LP / Regency Energy Finance Corp, 5,000 %, due 10/1/2022	618	0,09
	90	Energy Transfer Partners LP / Regency Energy Finance Corp, 4,500 %, due 11/1/2023	96	0,01
	2.710	Extraction Oil & Gas Inc, 144A, 5,625 %, due 2/1/2026	1.802	0,28
	3.370	FirstEnergy Corp, Serie C, 7,375 %, due 11/15/2031	4.834	0,74
	2.988	Freeport-McMoRan Inc, 3,550 %, due 3/1/2022	3.003	0,46
	6.170	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, due 3/15/2043	5.661	0,86
	3.719	GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418 %, due 11/15/2035	3.788	0,58
	50	General Electric Co, 6,750 %, due 3/15/2032	61	0,01
	1.046	General Electric Co, 6,875 %, due 1/10/2039	1.335	0,20
	800	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 5,625 %, due 6/15/2024	768	0,12
	405	Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	344	0,05
	1.840	HCA Inc, 5,000 %, due 3/15/2024	2.012	0,31
	1.290	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875 %, due 4/1/2027	1.363	0,21
	69	JPMorgan Chase & Co, Serie I, 5,736 %, Perpetual *	69	0,01
	1.810	JPMorgan Chase & Co, Serie U, 6,125 %, Perpetual *	1.949	0,30
	40	Kerr-McGee Corp, 7,875 %, due 9/15/2031	55	0,01
	40	Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,950 %, due 9/1/2022	42	0,01
	550	Kinder Morgan Inc/DE, 8,050 %, due 10/15/2030	739	0,11
	1.735	Kinder Morgan Inc/DE, 7,800 %, due 8/1/2031	2.413	0,37
	565	Kinder Morgan Inc/DE, 7,750 %, due 1/15/2032	794	0,12
	1.110	Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, due 7/15/2045	1.173	0,18
	2.026	L3Harris Technologies Inc, 5,054 %, due 4/27/2045	2.587	0,40
	40	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,625 %, due 11/1/2024	42	0,01
	1.530	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,875 %, due 11/1/2026	1.605	0,25
	326	Lehman Escrow Receipt, zero coupon, Perpetual †∞	4	–
	1.773	Match Group Inc, 144A, 5,000 %, due 12/15/2027	1.871	0,29
	770	MGM Resorts International, 6,625 %, due 12/15/2021	839	0,13
	1.750	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,250 %, due 8/1/2026	1.856	0,28
	2.170	Navient Corp, 8,000 %, due 3/25/2020	2.241	0,34
	900	Navient Corp, 5,875 %, due 10/25/2024	951	0,15
	760	Navios Maritime Acquisition Corp / Navios Acquisition Finance US Inc, 144A, 8,125 %, due 11/15/2021	622	0,10
	2.302	NCL Corp Ltd, 144A, 4,750 %, due 12/15/2021	2.342	0,36
	501	Newell Brands Inc, 3,850 %, due 4/1/2023	516	0,08
	1.410	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp, 7,500 %, due 11/1/2023	1.434	0,22
	1.010	NGPL PipeCo LLC, 144A, 7,768 %, due 12/15/2037	1.322	0,20
	1.190	NRG Energy Inc, 7,250 %, due 5/15/2026	1.309	0,20
	730	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, due 3/15/2022	683	0,10
	879	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, due 1/15/2023	800	0,12
	690	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, due 8/15/2029	703	0,11
	2.400	Pactiv LLC, 8,375 %, due 4/15/2027	2.586	0,40
	830	Quicken Loans Inc, 144A, 5,750 %, due 5/1/2025	869	0,13
	355	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, due 3/1/2032	509	0,08
	4.000	Sprint Capital Corp, 8,750 %, due 3/15/2032	5.020	0,77
	2.165	Sprint Communications Inc, 11,500 %, due 11/15/2021	2.549	0,39
	1.000	Sprint Corp, 7,875 %, due 9/15/2023	1.128	0,17
	2.680	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,250 %, due 11/15/2023	2.687	0,41

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
110	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,125 %, due 2/1/2025	113	0,02
120	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,375 %, due 2/1/2027	124	0,02
280	Time Warner Cable LLC, 4,125 %, due 2/15/2021	286	0,04
457	United Airlines 2014-2 Klasse B Pass Through Trust, Serie B, 4,625 %, due 9/3/2022	473	0,07
650	United Rentals North America Inc, 4,625 %, due 10/15/2025	671	0,10
1.980	United Rentals North America Inc, 5,500 %, due 5/15/2027	2.132	0,33
1.510	United Rentals North America Inc, 4,875 %, due 1/15/2028	1.589	0,24
460	Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, due 9/15/2027	478	0,07
1.370	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, due 2/15/2028	1.411	0,22
1.910	Wells Fargo & Co, Serie U, 5,875 %, Perpetual *	2.108	0,32
24	William Lyon Homes Inc, 7,000 %, due 8/15/2022	24	–
452	Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, due 1/15/2031	602	0,09
2.155	Williams Cos Inc/The, 5,750 %, due 6/24/2044	2.585	0,39
1.000	WPX Energy Inc, 8,250 %, due 8/1/2023	1.118	0,17
182	XPO Logistics Inc, 144A, 6,500 %, due 6/15/2022	186	0,03
2.420	XPO Logistics Inc, 144A, 6,125 %, due 9/1/2023	2.508	0,38
		135.254	20,66
Sambia – 0,42 % (28. February 2019: 0,39 %)			
290	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, due 4/1/2023	274	0,04
1.090	First Quantum Minerals Ltd, 6,500 %, due 3/1/2024	995	0,15
1.050	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, due 4/1/2025	966	0,15
570	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, due 3/1/2026	509	0,08
		2.744	0,42
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 270.539)		284.344	43,45
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 31,60 % (28. Februar 2019: 28,13 %)			
Argentinien – 0,62 % (28. Februar 2019: 1,75 %)			
ARS 66.030	Argentina Bonar Bonds, 61,719 %, due 3/1/2020 *	753	0,12
ARS 182.520	Argentina Bonar Bonds, 54,553 %, due 4/3/2022 *	1.311	0,20
ARS 62.300	Argentina POM Politica Monetaria, Serie POM, 66,777 %, due 6/21/2020 *	356	0,05
ARS 83.218	Argentine Bonos del Tesoro, 18,200 %, due 10/3/2021	418	0,06
1.020	Argentine Republic Government International Bond, 5,875 %, due 1/11/2028	387	0,06
2.510	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 7,875 %, due 6/15/2027	841	0,13
		4.066	0,62
Brasilien – 1,49 % (28. Februar 2019: 1,40 %)			
BRL 6.600	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2021	1.679	0,26
BRL 18.204	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2023	4.821	0,74
BRL 11.694	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2027	3.239	0,49
		9.739	1,49
Kolumbien – 1,66 % (28. Februar 2019: 1,24 %)			
8.380	Colombia Government International Bond, 5,625 %, due 2/26/2044	10.811	1,65
COP 171.800	Colombian TES, Series B, 10,000 %, due 7/24/2024	60	0,01
		10.871	1,66
Ägypten – 0,37 % (28. Februar 2019: 0,31 %)			
2.200	Egypt Government International Bond, 7,600 %, due 3/1/2029	2.380	0,37
Ghana – 0,33 % (28. Februar 2019: 0,29 %)			
2.200	Ghana Government International Bond, 7,625 %, due 5/16/2029	2.179	0,33
Indonesien – 2,85 % (28. Februar 2019: 2,57 %)			
990	Indonesia Government International Bond, 3,750 %, due 4/25/2022	1.022	0,16
IDR 133.339.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR59, 7,000 %, due 5/15/2027	9.264	1,41
IDR 111.280.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR78, 8,250 %, due 5/15/2029	8.371	1,28
		18.657	2,85
Mexiko – 5,67 % (28. Februar 2019: 4,73 %)			
MXN 52.497	Mexican Bonos, Series M, 6,500 %, due 6/9/2022	2.593	0,40
MXN 191.250	Mexican Bonos, Serie M 20, 7,500 %, due 6/3/2027	9.850	1,50
MXN 479.179	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, due 11/13/2042	24.668	3,77
		37.111	5,67
Nigeria – 0,13 % (28. Februar 2019: 0,12 %)			
900	Nigeria Government International Bond, 7,625 %, due 11/28/2047	869	0,13
Russland – 4,53 % (28. Februar 2019: 3,89 %)			
RUB 668.557	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6211, 7,000 %, due 1/25/2023	10.123	1,55
RUB 1.291.162	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, due 1/19/2028	19.529	2,98
		29.652	4,53
Südafrika – 1,23 % (28. Februar 2019: 1,19 %)			
ZAR 7.261	Republic of South Africa Government Bond, Serie R209, 6,250 %, due 3/31/2036	347	0,05
ZAR 166.500	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500 %, due 2/28/2041	7.716	1,18
		8.063	1,23
Türkei – 1,00 % (28. Februar 2019: 0,74 %)			
TRY 35.040	Turkey Government Bond, 10,600 %, due 2/11/2026	4.808	0,73
1.690	Turkey Government International Bond, 7,250 %, due 12/23/2023	1.751	0,27
		6.559	1,00
USA – 11,72 % (28. Februar 2019: 9,90 %)			
454	United States Treasury Note/ Bond, 1,250 %, due 10/31/2019	453	0,07
39.122	United States Treasury Note/ Bond, 2,875 %, due 10/31/2023	41.412	6,33
5.360	United States Treasury Note/ Bond, 2,250 %, due 11/15/2024	5.582	0,85
440	United States Treasury Note/ Bond, 1,500 %, due 8/15/2026	441	0,07
1.460	United States Treasury Note/ Bond, 2,000 %, due 11/15/2026	1.515	0,23
770	United States Treasury Note/ Bond, 2,250 %, due 2/15/2027	813	0,12
1.650	United States Treasury Note/ Bond, 3,000 %, due 5/15/2045	2.001	0,31
6.325	United States Treasury Note/ Bond, 3,000 %, due 11/15/2045	7.685	1,17
1.360	United States Treasury Note/ Bond, 2,500 %, due 5/15/2046	1.512	0,23
7.140	United States Treasury Note/ Bond, 2,250 %, due 8/15/2046	7.562	1,16
3.940	United States Treasury Note/ Bond, 2,875 %, due 11/15/2046	4.701	0,72
360	United States Treasury Note/ Bond, 3,000 %, due 2/15/2047	440	0,07
120	United States Treasury Note/ Bond, 3,125 %, due 5/15/2048	151	0,02
1.080	United States Treasury Note/ Bond, 3,375 %, due 11/15/2048	1.420	0,22
820	United States Treasury Note/ Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	1.010	0,15
		76.698	11,72
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 238.669)		206.844	31,60
Schuldscheindarlehen – 4,60 % (28. Februar 2019: 5,03 %)			
1.647	Air Medical Group Holdings Inc, 5,432 %, due 4/28/2022 *	1.555	0,24
546	Albertson's LLC, 5,234 %, due 8/7/2026 *	548	0,08
896	Almonde Inc, 5,734 %, due 4/28/2024 *	867	0,13
81	American Axle & Manufacturing Inc, 4,520 %, due 4/6/2024 *	80	0,01
1.161	Aramark Services Inc, 4,080 %, due 3/11/2025 *	1.162	0,18
993	Berry Global Inc, 4,451 %, due 10/1/2022 *	995	0,15
723	Brightview Landscapes LLC, 4,750 %, due 8/15/2025 *	724	0,11
853	Caesars Resort Collection LLC, 4,984 %, due 12/22/2024 *	842	0,13
209	CBS Radio Inc, 4,991 %, due 11/17/2024 *	209	0,03
288	Change Healthcare Holdings LLC, 4,734 %, due 3/1/2024 *	285	0,04
665	Charter Communications Operating LLC, 4,330 %, due 4/30/2025 *	668	0,10
483	CWGS Group LLC, 4,984 %, due 11/8/2023 *	419	0,06
1.550	Flying Fortress Holdings LLC, 4,080 %, due 10/30/2022 *	1.554	0,24
GBP 426	GVC Holdings Plc, 4,023 %, due 3/16/2024 *	520	0,08
505	HCA Inc, 4,330 %, due 3/13/2025 *	508	0,08

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Schuldscheindarlehen – (Fortsetzung)			
1.116	Hilton Worldwide Finance LLC, 4,016 %, due 6/21/2026 *	1.121	0,17
685	Jaguar Holding Co II, 4,734 %, due 8/18/2022 *	683	0,11
760	Level 3 Financing Inc, 4,484 %, due 2/17/2024 *	761	0,12
1.244	MGM Growth Properties Operating Partnership, 4,234 %, due 3/19/2025 *	1.247	0,19
1.676	Michaels Stores Inc, 4,769 %, due 1/28/2023 *	1.593	0,24
464	MPH Acquisition Holdings LLC, 5,080 %, due 6/7/2023 *	433	0,07
515	Party City Holdings Inc, 4,740 %, due 8/19/2022 *	509	0,08
1.870	Petco Animal Supplies Inc, 5,506 %, due 1/26/2023 *	1.355	0,21
669	Prime Security Services Borrower LLC, 4,984 %, due 5/2/2022 *	669	0,10
569	Reynolds Group Holdings Inc, 4,984 %, due 2/5/2023 *	569	0,09
203	RPI Finance Trust, 4,234 %, due 4/17/2023 *	204	0,03
1.665	Scientific Games International Inc, 4,984 %, due 8/14/2024 *	1.648	0,25
80	Scientific Games International Inc, 4,984 %, due 8/14/2024 *	79	0,01
1.137	Sprint Communications Inc, 4,750 %, due 2/3/2024 *	1.132	0,17
EUR 2.090	TDC A/S Term Loan, 2,750 %, due 6/11/2025 *	2.303	0,35
379	Trans Union LLC, 4,234 %, due 4/9/2023 *	380	0,06
1.298	Univision Communications Inc, 4,984 %, due 3/15/2024 *	1.244	0,19
2.007	Valeant Pharmaceuticals International, 5,201 %, due 5/28/2025 *	2.012	0,31
186	VICI Properties 1 LLC, 4,272 %, due 12/22/2024 *	187	0,03
57	Vistra Operations Co LLC, 4,234 %, due 8/4/2023 *	57	0,01
976	Western Digital Corp, 4,012 %, due 4/29/2023 *	975	0,15
Loan Notes insgesamt (Anschaffungskosten USD 31.153)		30.097	4,60
Termineinlagen – 1,99 % (28. Februar 2019: 3,15 %)			
13.047	Barclays Capital London, 2,080 %, due 9/3/2019	13.047	1,99
Termineinlagen insgesamt (Anschaffungskosten USD 13.047)		13.047	1,99

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Investmentfonds - 9,75 % (28. Februar 2019: 9,52 %)			
1.001	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse M	12.171	1,86
79	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – Klasse LM USD, ausschüttend (M)	7.868	1,20
EUR 82	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Euro High Yield Fund – LM Klasse EUR (thesaurierend)	15.923	2,44
217	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset US High Yield Fund – Klasse LM USD, ausschüttend (M)	18.715	2,86
72	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Legg Mason Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD thesaurierend	9.108	1,39
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 59.674)		63.785	9,75
Stammaktien – 0,06 % (28. Februar 2019: 0,10 %)			
USA – 0,06 % (28. Februar 2019: 0,10 %)			
44	Berry Petroleum Corp	349	0,05
57	Hercules Offshore Inc †∞	37	0,01
9	Montage Resources Corp	26	–
		412	0,06
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 1.380)		412	0,06
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 645.679)		630.100	96,27
Devisenterminkontrakte – 0,32 % (28. Februar 2019: 1,56 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		2.086	0,32
Futures – 0,03 % (28. Februar 2019: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		164	0,03
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		632.350	96,62
Credit Default Swaps – (0,10 %) (28. Februar 2019: (0,13 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(624)	(0,10)
Devisenterminkontrakte – (0,51 %) (28. Februar 2019: (0,17 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(3.358)	(0.51)

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Futures – (0,27 %) (28. Februar 2019: 0,21 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(1.762)	(0,27)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		(5.744)	(0,88)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Verlust		626.606	95,74
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		27.889	4,26
Nettovermögen insgesamt		USD 654.495	100,00

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

144A Von der Registrierung 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 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 70.651.000 und machten 10,80 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

† Illiquide.

∞ Das Wertpapier wurde vom Anlageverwalter nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen
ARS – Argentinischer Peso
BRL – Brasilianischer Real
COP – Kolumbianischer Peso
EUR – Euro
GBP – Britisches Pfund
IDR – Indonesische Rupiah
MXN – Mexikanischer Peso
RUB – Russischer Rubel
TRY – Türkische Lira
ZAR – Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	78,87
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	4,54
Investmentfonds	9,62
Einlagen bei Kreditinstituten	1,97
Derivate	0,34
Sonstige Aktiva	4,66
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kauf/Verkauf Schutz	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 %	Kauf	20.6.2024	9.306	USD (624)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)					USD –
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (972))					(624)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (972))					USD (624)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–	USD	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	ZAR	233	Verkauf	USD	15		–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	24	Verkauf	USD	29		–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	16	Verkauf	EUR	15		–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	80	Verkauf	USD	89		(1)
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	ZAR	13.236	Verkauf	USD	864		9
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	4	Verkauf	USD	5		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	832	Verkauf	AUD	1.227		4
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	194	Verkauf	EUR	174		2
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	149	Verkauf	GBP	122		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	788	Verkauf	GBP	649		(1)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	SGD	12		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	25	Verkauf	SGD	34		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	18.176	Verkauf	USD	20.416		(424)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	108.446	Verkauf	USD	73.590		(535)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	314.098	Verkauf	USD	382.530		(163)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	23.174	Verkauf	USD	6.012		(190)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	ZAR	62.868	Verkauf	USD	4.174		(34)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	USD	–		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CHF	1.755	Verkauf	USD	1.804		(29)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.393	Verkauf	USD	1.010		(5)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	ZAR	1.931	Verkauf	USD	126		1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.356	Verkauf	ZAR	36.253		(32)
16.09.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	4.200	Verkauf	ARS	277.200		(232)
16.09.19	Goldman Sachs	Kauf	ARS	122.199	Verkauf	USD	2.062		(109)
21.10.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	1.944	Verkauf	RUB	130.480		1
21.10.19	Citi	Kauf	IDR	34.311.880	Verkauf	USD	2.388		12
21.10.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	9.417	Verkauf	PHP	496.050		(74)
21.10.19	JP Morgan	Kauf	INR	417.815	Verkauf	USD	5.814		(30)
21.10.19	Morgan Stanley	Kauf	BRL	5.364	Verkauf	USD	1.341		(50)
21.11.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	17.651	Verkauf	SGD	24.444		19
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	5.576	Verkauf	EUR	4.935		120
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.332	Verkauf	MXN	26.590		23
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	TRY	5.657	Verkauf	USD	973		(32)
21.11.19	HSBC	Kauf	USD	63.688	Verkauf	EUR	56.428		1.287
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	12.107	Verkauf	EUR	10.758		211
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	2.119	Verkauf	GBP	1.750		(17)
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	11.354	Verkauf	MXN	225.270		265
21.11.19	Morgan Stanley	Kauf	USD	6.103	Verkauf	EUR	5.400		132
21.11.19	Morgan Stanley	Kauf	JPY	3.149.250	Verkauf	USD	30.136		(325)
21.11.19	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.870	Verkauf	ZAR	29.150		(32)
21.11.19	UBS	Kauf	USD	6.547	Verkauf	GBP	5.403		(49)
21.11.19	UBS	Kauf	EUR	48.465	Verkauf	USD	54.589		(994)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 11.426)									2.086
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (1.236))									(3.358)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 10.190)								USD	(1.272)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nominal wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
Euro-Bund December 2019	(162)	USD (31.386)	USD	–
Euro-Bund September 2019	(128)	(25.196)		(1.157)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2019	(9)	(2.219)		(277)
U.S. 10 Year Note (CBT) December 2019	(607)	(79.953)		(328)
U.S. 5 Year Note (CBT) December 2019	254	30.474		50
U.S. Ultra Bond (CBT) December 2019	52	10.267		114
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 69)			USD	164
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (1.532))				(1.762)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (1.463))			USD	(1.598)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Asset-Backed Securities - 4,60 % (28. Februar 2019: 4,71 %)			
460	Avery Point VI CLO Ltd, Serie 2015 6A, Klasse DR, 144A, 5,237 %, due 8/5/2027 *	449	0,29
440	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Klasse C, 144A, 5,428 %, due 4/20/2031 *	417	0,27
300	BlueMountain CLO 2012-2 Ltd, Serie 2012 2A, Klasse ER2, 144A, 7,886 %, due 11/20/2028 *	287	0,19
500	BlueMountain CLO 2015-2 Ltd, Serie 2015 2A, Klasse ER, 144A, 7,500 %, due 7/18/2027 *	466	0,30
300	Catskill Park CLO Ltd, Serie 2017 1A, Klasse D, 144A, 8,278 %, due 4/20/2029 *	285	0,19
300	Cent CLO 24 Ltd, Serie 2015 24A, Klasse CR, 144A, 5,453 %, due 10/15/2026 *	296	0,19
250	Cumberland Park CLO Ltd, Serie 2015 2A, Klasse ER, 144A, 7,928 %, due 7/20/2028 *	240	0,16
250	Gilbert Park CLO Ltd, Serie 2017 1A, Klasse E, 144A, 8,703 %, due 10/15/2030 *	243	0,16
300	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd, Serie 2014 9A, Klasse DR2, 144A, 5,256 %, due 10/29/2029 *	292	0,19
250	Greenwood Park CLO Ltd, Serie 2018 1A, Klasse E, 144A, 7,253 %, due 4/15/2031 *	222	0,14
567	Jackson Mill CLO Ltd, Serie 2015 1A, Klasse DR, 144A, 5,103 %, due 4/15/2027 *	563	0,36
300	LCM XXII Ltd 22A, Klasse DR, 144A, 7,778 %, due 10/20/2028 *	269	0,17
430	OZLM VII Ltd, Serie 2014 7RA, Klasse CR, 144A, 5,303 %, due 7/17/2029 *	402	0,26
567	OZLM XII Ltd, Serie 2015 12A, Klasse D, 144A, 7,666 %, due 4/30/2027 *	532	0,34
580	Saranac CLO III Ltd, Serie 2014 3A, Klasse DR, 144A, 5,593 %, due 6/22/2030 *	553	0,36
250	Sound Point Clo XV Ltd, Serie 2017 1A, Klasse E, 144A, 8,219 %, due 1/23/2029 *	234	0,15
750	THL Credit Wind River 2016-1 CLO Ltd, Serie 2016 1A, Klasse ER, 144A, 7,853 %, due 7/15/2028 *	716	0,46
250	Treman Park CLO Ltd, Serie 2015 1A, Klasse ERR, 144A, 7,778 %, due 10/20/2028 *	243	0,16
320	Venture XVII CLO Ltd, Serie 2014 17A, Klasse DRR, 144A, 5,123 %, due 4/15/2027 *	311	0,20
100	Venture XVII CLO Ltd, Serie 2014 17A, Klasse ERR, 144A, 8,043 %, due 4/15/2027 *	90	0,06
Asset-Backed Securities insgesamt (Anschaffungskosten USD 7.446)		7.110	4,60
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 84,46 % (28. Februar 2019: 86,25 %)			
Argentinien – 0,68 % (28. Februar 2019: 0,92 %)			
200	Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, due 5/2/2025	150	0,10
1.170	YPF SA, 144A, 8,500 %, due 3/23/2021	903	0,58
		1.053	0,68
Brasilien – 0,38 % (28. Februar 2019: 0,94 %)			
200	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 144A, 6,125 %, Perpetual *	202	0,13
330	Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, due 1/17/2027	392	0,25
		594	0,38
Kanada – 3,22 % (28. Februar 2019: 4,02 %)			
100	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,625 %, due 1/15/2022	101	0,07
440	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,250 %, due 5/15/2024	455	0,29
380	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 5,000 %, due 10/15/2025	393	0,25
420	Cott Holdings Inc, 144A, 5,500 %, due 4/1/2025	440	0,28
330	GFL Environmental Inc, 144A, 5,375 %, due 3/1/2023	333	0,22
340	GFL Environmental Inc, 144A, 8,500 %, due 5/1/2027	373	0,24
756	Hudbay Minerals Inc, 144A, 7,625 %, due 1/15/2025	771	0,50
500	MEG Energy Corp, 144A, 6,375 %, due 1/30/2023	474	0,31
660	MEG Energy Corp, 144A, 7,000 %, due 3/31/2024	631	0,41
80	MEG Energy Corp, 144A, 6,500 %, due 1/15/2025	81	0,05
530	Precision Drilling Corp, 144A, 7,125 %, due 1/15/2026	476	0,31
440	Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, due 9/30/2022	446	0,29
		4.974	3,22
Kaimaninseln – 0,90 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
1.400	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, due 9/15/2024	1.396	0,90
Kolumbien – 0,13 % (28. Februar 2019: 0,13 %)			
200	Millicom International Cellular SA, 144A, 5,125 %, due 1/15/2028	209	0,13
Dänemark – 0,15 % (28. Februar 2019: 0,14 %)			
210	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, due 1/12/2024	232	0,15
Frankreich – 2,25 % (28. Februar 2019: 2,00 %)			
2.200	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, due 5/1/2026	2.354	1,52
200	Altice France SA/France, 144A, 8,125 %, due 2/1/2027	221	0,14
780	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetual *	912	0,59
		3.487	2,25
Deutschland – 0,56 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
400	Mercer International Inc, 6,500 %, due 2/1/2024	413	0,27
450	Mercer International Inc, 5,500 %, due 1/15/2026	446	0,29
		859	0,56
Irland – 0,67 % (28. Februar 2019: 1,54 %)			
350	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,625 %, due 5/15/2023	359	0,23
650	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 6,000 %, due 2/15/2025	681	0,44
		1.040	0,67
Italien – 1,63 % (28. Februar 2019: 1,14 %)			
720	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, due 1/15/2026	760	0,49
1.080	Telecom Italia SpA/Milano,144A, 5,303 %, due 5/30/2024	1.160	0,75
530	UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, due 4/2/2034 *	599	0,39
		2.519	1,63
Luxemburg – 1,38 % (28. Februar 2019: 1,15 %)			
800	Altice Luxembourg SA, 144A, 10,500 %, due 5/15/2027	872	0,56
340	ARD Securities Finance SARL, 144A, 8,750 %, due 1/31/2023	354	0,23
105	Intelsat Jackson Holdings SA, 5,500 %, due 8/1/2023	96	0,06
780	Intelsat Jackson Holdings SA, 144A, 8,000 %, due 2/15/2024	814	0,53
		2.136	1,38
Macau — 0,46 % (February 28, 2019: 0,30 %)			
200	MGM China Holdings Ltd, 144A, 5,375 %, due 5/15/2024	206	0,13
440	Sands China Ltd, 5,400 %, due 8/8/2028	509	0,33
		715	0,46
Niederlande – 0,80 % (28. Februar 2019: 0,66 %)			
330	NatWest Markets NV, Serie B, 7,750 %, due 5/15/2023	379	0,25
420	UPC Holding BV, 144A, 5,500 %, due 1/15/2028	439	0,28
400	UPCB Finance IV Ltd, 144A, 5,375 %, due 1/15/2025	414	0,27
		1.232	0,80
Spanien – 0,27 % (28. Februar 2019: 0,25 %)			
400	Banco Santander SA, 3,800 %, due 2/23/2028	424	0,27
Schweiz – 0,73 % (28. Februar 2019: 0,77 %)			
470	Credit Suisse Group AG, 144A, 6,375 %, Perpetual *	487	0,32
200	Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, Perpetual *	213	0,14
400	UBS Group Funding Switzerland AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	424	0,27
		1.124	0,73
Vereinigte Arabische Emirate - 1,00 % (28. Februar 2019: 1,02 %)			
960	DAE Funding LLC, 144A, 5,750 %, due 11/15/2023	1.015	0,66
590	Shelf Drilling Holdings Ltd, 144A, 8,250 %, due 2/15/2025	528	0,34
		1.543	1,00
Großbritannien – 3,13 % (28. Februar 2019: 2,09 %)			
1.030	Barclays Bank Plc, 7,625 %, due 11/21/2022	1.136	0,74
750	Barclays Plc, 5,088 %, due 6/20/2030 *	780	0,51
480	Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual *	500	0,32
620	HSBC Holdings Plc, 6,500 %, Perpetual *	638	0,41
134	Royal Bank of Scotland Group Plc, 5,125 %, due 5/28/2024	142	0,09
200	Virgin Media Finance Plc, 4,875 %, due 2/15/2022	199	0,13
200	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,250 %, due 1/15/2026	206	0,13
200	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, due 8/15/2026	210	0,14
980	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, due 5/15/2029	1.026	0,66
		4.837	3,13
USA – 65,41 % (28. Februar 2019: 68,42 %)			
440	ADT Security Corp/The, 4,125 %, due 6/15/2023	448	0,29
130	Ahern Rentals Inc, 144A, 7,375 %, due 5/15/2023	113	0,07
240	Air Medical Group Holdings Inc, 144A, 6,375 %, due 5/15/2023	212	0,14
1.500	Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, due 5/15/2028	1.564	1,01
860	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, due 7/15/2026	916	0,59
520	Allison Transmission Inc, 144A, 5,000 %, due 10/1/2024	536	0,35
441	Ally Financial Inc, 5,750 %, due 11/20/2025	507	0,33

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
400	Ally Financial Inc, 8,000 %, due 11/1/2031	561	0,36
260	Altria Group Inc, 5,950 %, due 2/14/2049	334	0,22
270	AMC Entertainment Holdings Inc, 6,125 %, due 5/15/2027	250	0,16
110	American Axle & Manufacturing Inc, 6,250 %, due 4/1/2025	104	0,07
670	American Axle & Manufacturing Inc, 6,500 %, due 4/1/2027	617	0,40
630	American Media LLC, 144A, 10,500 %, due 12/31/2026	665	0,43
410	Amkor Technology Inc, 144A, 6,625 %, due 9/15/2027	448	0,29
480	ASP AMC Merger Sub Inc, 144A, 8,000 %, due 5/15/2025	325	0,21
500	Bank of America Corp, Serie FF, 5,875 %, Perpetual *	544	0,35
1.560	Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, due 4/1/2026	1.771	1,14
280	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, due 4/15/2025	289	0,19
200	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, due 11/1/2025	210	0,14
180	Bausch Health Cos Inc, 144A, 9,000 %, due 12/15/2025	203	0,13
400	BBA US Holdings Inc, 144A, 5,375 %, due 5/1/2026	419	0,27
500	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,125 %, due 11/15/2022	505	0,33
860	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, due 7/15/2026	851	0,55
360	Boyne USA Inc, 144A, 7,250 %, due 5/1/2025	395	0,26
271	Brinker International Inc, 144A, 5,000 %, due 10/1/2024	280	0,18
346	BWX Technologies Inc, 144A, 5,375 %, due 7/15/2026	368	0,24
399	Carriage Services Inc, 144A, 6,625 %, due 6/1/2026	410	0,27
150	Carrizo Oil & Gas Inc, 8,250 %, due 7/15/2025	146	0,09
1.060	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, due 5/1/2023	1.087	0,70
740	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, due 5/1/2027	784	0,51
300	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,000 %, due 2/1/2028	316	0,20
700	CDK Global Inc, 5,875 %, due 6/15/2026	746	0,48
250	Centene Corp, 4,750 %, due 1/15/2025	260	0,17
630	Centene Corp, 144A, 5,375 %, due 6/1/2026	675	0,44
790	Century Communities Inc, 5,875 %, due 7/15/2025	817	0,53
410	CenturyLink Inc, 5,625 %, due 4/1/2025	420	0,27
530	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, due 10/23/2045	656	0,42
630	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 5,875 %, due 3/31/2025	704	0,46
113	Cheniere Energy Inc, 4,250 %, due 3/15/2045	88	0,06
140	Chesapeake Energy Corp, 5,500 %, due 9/15/2026	89	0,06
940	Chesapeake Energy Corp, 8,000 %, due 6/15/2027	684	0,44
550	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, due 3/15/2026	529	0,34
670	CIT Group Inc, 4,750 %, due 2/16/2024	721	0,47
250	Citigroup Inc, Serie P, 5,950 %, Perpetual *	268	0,17
810	Citigroup Inc, Serie M, 6,300 %, Perpetual *	860	0,56
390	Cleaver-Brooks Inc, 144A, 7,875 %, due 3/1/2023	360	0,23
590	Cogent Communications Group Inc, 144A, 5,375 %, due 3/1/2022	615	0,40
290	CommScope Inc, 144A, 8,250 %, due 3/1/2027	285	0,18
170	CommScope Technologies LLC, 144A, 5,000 %, due 3/15/2027	143	0,09
–	Continental Airlines 2000-1 Klasse B Pass Through Trust, Serie 001B, Klasse B, 8,388 %, due 11/1/2020	–	–
300	CoreCivic Inc, 5,000 %, due 10/15/2022	298	0,19
470	Covanta Holding Corp, 5,875 %, due 7/1/2025	492	0,32
650	Covey Park Energy LLC / Covey Park Finance Corp, 144A, 7,500 %, due 5/15/2025	465	0,30
300	CSC Holdings LLC, 144A, 10,875 %, due 10/15/2025	341	0,22
1.310	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, due 2/1/2029	1.470	0,95
340	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 5,250 %, due 6/1/2025	351	0,23
270	DaVita Inc, 5,000 %, due 5/1/2025	271	0,18
600	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, due 9/15/2037	633	0,41
320	Delphi Technologies Plc, 144A, 5,000 %, due 10/1/2025	278	0,18
180	Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co, 144A, 5,375 %, due 8/15/2026	189	0,12
1.040	DISH DBS Corp, 5,875 %, due 11/15/2024	993	0,64
2.703	DISH DBS Corp, 7,750 %, due 7/1/2026	2.662	1,72
250	Donnelley Financial Solutions Inc, 8,250 %, due 10/15/2024	259	0,17
340	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,500 %, due 1/30/2026	355	0,23
200	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, due 1/30/2028	211	0,14
360	Entercom Media Corp, 144A, 6,500 %, due 5/1/2027	374	0,24
420	ESH Hospitality Inc, 144A, 5,250 %, due 5/1/2025	435	0,28
570	Extraction Oil & Gas Inc, 144A, 7,375 %, due 5/15/2024	430	0,28
860	Extraction Oil & Gas Inc, 144A, 5,625 %, due 2/1/2026	572	0,37
200	Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc, 144A, 5,500 %, due 5/1/2025	213	0,14
440	FirstCash Inc, 144A, 5,375 %, due 6/1/2024	459	0,30
850	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, due 11/15/2025	855	0,55
360	Flex Acquisition Co Inc, 144A, 7,875 %, due 7/15/2026	327	0,21
450	Flexi-Van Leasing Inc, 144A, 10,000 %, due 2/15/2023	442	0,29
480	Forestar Group Inc, 144A, 8,000 %, due 4/15/2024	518	0,33
436	Freeport-McMoRan Inc, 3,550 %, due 3/1/2022	438	0,28
2.160	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, due 3/15/2043	1.982	1,28
540	Frontdoor Inc, 144A, 6,750 %, due 8/15/2026	587	0,38
470	FXI Holdings Inc, 144A, 7,875 %, due 11/1/2024	418	0,27
520	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 5,625 %, due 6/15/2024	499	0,32
1.040	GEO Group Inc/The, 6,000 %, due 4/15/2026	905	0,58
350	Golden Nugget Inc, 144A, 8,750 %, due 10/1/2025	368	0,24
800	Greif Inc, 144A, 6,500 %, due 3/1/2027	842	0,54
120	Hanesbrands Inc, 144A, 4,625 %, due 5/15/2024	126	0,08
1.050	Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, due 5/15/2026	1.112	0,72
270	Harsco Corp, 144A, 5,750 %, due 7/31/2027	280	0,18
1.610	HCA Inc, 5,625 %, due 9/1/2028	1.836	1,19
127	HCA Inc, 7,500 %, due 11/15/2095	140	0,09
430	Hilton Domestic Operating Co Inc, 5,125 %, due 5/1/2026	455	0,29
352	HLF Financing Sarl LLC / Herbalife International Inc, 144A, 7,250 %, due 8/15/2026	348	0,22
360	Indigo Natural Resources LLC, 144A, 6,875 %, due 2/15/2026	299	0,19
760	International Game Technology Plc, 144A, 6,500 %, due 2/15/2025	838	0,54
440	j2 Cloud Services LLC / j2 Global Co-Obligor Inc, 144A, 6,000 %, due 7/15/2025	465	0,30
1.042	L Brands Inc, 5,250 %, due 2/1/2028	953	0,62
860	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,875 %, due 11/1/2026	902	0,58
510	Lennar Corp, 4,500 %, due 4/30/2024	544	0,35
80	Lennar Corp, 5,250 %, due 6/1/2026	87	0,06
530	Lennar Corp, 4,750 %, due 11/29/2027	579	0,37
430	Level 3 Financing Inc, 5,250 %, due 3/15/2026	449	0,29
730	Levi Strauss & Co, 5,000 %, due 5/1/2025	763	0,49
391	Liberty Media Corp, 144A, 2,125 %, due 3/31/2048	401	0,26
425	Lions Gate Capital Holdings LLC, 5,875 %, due 11/1/2024	444	0,29
55	Lions Gate Capital Holdings LLC, 144A, 5,875 %, due 11/1/2024	57	0,04
210	MAI Holdings Inc, Serie AI, 9,500 %, due 6/1/2023	96	0,06
510	Match Group Inc, 144A, 5,000 %, due 12/15/2027	538	0,35
390	Meredith Corp, 6,875 %, due 2/1/2026	413	0,27
200	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc, 4,500 %, due 9/1/2026	211	0,14
200	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc, 4,500 %, due 1/15/2028	206	0,13
90	Montage Resources Corp, 8,875 %, due 7/15/2023	68	0,04
500	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, due 10/15/2027	535	0,35
170	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4,625 %, due 8/1/2029	177	0,11
450	Murphy Oil USA Inc, 5,625 %, due 5/1/2027	475	0,31
225	Murray Energy Corp, 144A, 12,000 %, due 4/15/2024	23	0,01
500	Navient Corp, 6,750 %, due 6/25/2025	539	0,35
640	Navient Corp, 6,750 %, due 6/15/2026	686	0,44

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung) USA – (Fortsetzung)			
700	Navios Maritime Acquisition Corp / Navios Acquisition Finance US Inc, 144A, 8,125 %, due 11/15/2021	573	0,37
150	Netflix Inc, 5,375 %, due 2/1/2021	156	0,10
120	Netflix Inc, 5,875 %, due 2/15/2025	133	0,09
200	Netflix Inc, 4,375 %, due 11/15/2026	205	0,13
860	Netflix Inc, 144A, 6,375 %, due 5/15/2029	993	0,64
330	Netflix Inc, 144A, 5,375 %, due 11/15/2029	360	0,23
410	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp, 7,500 %, due 11/1/2023	417	0,27
270	NGPL PipeCo LLC, 144A, 4,875 %, due 8/15/2027	288	0,19
210	NGPL PipeCo LLC, 144A, 7,768 %, due 12/15/2037	275	0,18
854	Northern Oil and Gas Inc, 8,500 %, due 5/15/2023	883	0,57
340	Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, due 11/1/2022	213	0,14
380	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, due 3/15/2022	355	0,23
210	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, due 1/15/2023	191	0,12
360	Olin Corp, 5,000 %, due 2/1/2030	361	0,23
825	Pactiv LLC, 8,375 %, due 4/15/2027	889	0,57
320	Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, due 4/1/2027	299	0,19
499	Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, due 4/15/2027	482	0,31
630	Party City Holdings Inc, 144A, 6,625 %, due 8/1/2026	602	0,39
140	Pilgrim's Pride Corp, 144A, 5,875 %, due 9/30/2027	151	0,10
380	Polaris Intermediate Corp, 144A, 8,500 %, due 12/1/2022	321	0,21
152	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 9,250 %, due 5/15/2023	160	0,10
140	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,250 %, due 4/15/2024	145	0,09
470	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,750 %, due 4/15/2026	491	0,32
120	Pyxus International Inc, 9,875 %, due 7/15/2021	95	0,06
200	Quicken Loans Inc, 144A, 5,750 %, due 5/1/2025	210	0,14
1.020	Quicken Loans Inc, 144A, 5,250 %, due 1/15/2028	1.062	0,69
220	Radian Group Inc, 4,875 %, due 3/15/2027	225	0,15
308	Range Resources Corp, 5,000 %, due 3/15/2023	273	0,18
470	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc, 144A, 8,250 %, due 5/1/2023	503	0,32
290	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc, 144A, 9,750 %, due 12/1/2026	311	0,20
259	Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 7,500 %, due 7/15/2038	295	0,19
423	Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, due 4/15/2040	470	0,30
465	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 5,625 %, due 12/1/2025	467	0,30
180	Scientific Games International Inc, 10,000 %, due 12/1/2022	187	0,12
930	Scientific Games International Inc, 144A, 5,000 %, due 10/15/2025	963	0,62
40	Service Corp International/US, 5,375 %, due 5/15/2024	41	0,03
372	Service Corp International/US, 7,500 %, due 4/1/2027	448	0,29
300	Service Corp International/US, 5,125 %, due 6/1/2029	323	0,21
180	ServiceMaster Co LLC/The, 144A, 5,125 %, due 11/15/2024	189	0,12
355	ServiceMaster Co LLC/The, 7,450 %, due 8/15/2027	395	0,26
400	Simmons Foods Inc, 144A, 5,750 %, due 11/1/2024	381	0,25
170	Sirius XM Radio Inc, 144A, 4,625 %, due 7/15/2024	178	0,11
110	Spectrum Brands Inc, 6,125 %, due 12/15/2024	115	0,07
540	Spectrum Brands Inc, 5,750 %, due 7/15/2025	564	0,36
730	Speedway Motorsports Inc, 5,125 %, due 2/1/2023	743	0,48
1.380	Sprint Capital Corp, 8,750 %, due 3/15/2032	1.732	1,12
1.073	Sprint Communications Inc, 11,500 %, due 11/15/2021	1.263	0,82
760	Sprint Corp, 7,875 %, due 9/15/2023	857	0,55
920	Sprint Corp, 7,625 %, due 2/15/2025	1.032	0,67
570	Standard Industries Inc/NJ, 144A, 4,750 %, due 1/15/2028	575	0,37
410	Suburban Propane Partners LP/ Suburban Energy Finance Corp, 5,875 %, due 3/1/2027	417	0,27
230	Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp, 144A, 5,875 %, due 5/15/2025	228	0,15
260	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 144A, 5,125 %, due 6/1/2025	267	0,17
230	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 144A, 6,500 %, due 3/15/2027	248	0,16
250	Talen Energy Supply LLC, 144A, 10,500 %, due 1/15/2026	228	0,15
300	Talen Energy Supply LLC, 144A, 6,625 %, due 1/15/2028	292	0,19
400	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,250 %, due 11/15/2023	401	0,26
350	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,875 %, due 4/15/2026	368	0,24
110	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 6,500 %, due 7/15/2027	120	0,08
150	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 6,875 %, due 1/15/2029	166	0,11
1.210	Tenet Healthcare Corp, 6,750 %, due 6/15/2023	1.248	0,81
150	Tenet Healthcare Corp, 4,625 %, due 7/15/2024	155	0,10
270	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, due 7/1/2038	347	0,22
1.200	T-Mobile USA Inc, 6,375 %, due 3/1/2025 ∞	–	–
370	T-Mobile USA Inc, 6,375 %, due 3/1/2025	384	0,25
530	T-Mobile USA Inc, 4,750 %, due 2/1/2028	560	0,36
290	T-Mobile USA Inc, 4,750 %, due 2/1/2028 ∞	–	–
1.030	TopBuild Corp, 144A, 5,625 %, due 5/1/2026	1.079	0,70
10	Transocean Inc, 144A, 9,000 %, due 7/15/2023	10	0,01
340	Transocean Inc, 144A, 7,250 %, due 11/1/2025	311	0,20
100	Transocean Inc, 144A, 7,500 %, due 1/15/2026	92	0,06
180	Transocean Inc, 6,800 %, due 3/15/2038	120	0,08
276	Transocean Pontus Ltd, 144A, 6,125 %, due 8/1/2025	281	0,18
670	United Rentals North America Inc, 6,500 %, due 12/15/2026	731	0,47
400	United Rentals North America Inc, 5,500 %, due 5/15/2027	431	0,28
90	United Rentals North America Inc, 4,875 %, due 1/15/2028	95	0,06
1.230	United Rentals North America Inc, 5,250 %, due 1/15/2030	1.319	0,85
460	Univision Communications Inc, 144A, 5,125 %, due 2/15/2025	446	0,29
260	US Concrete Inc, 6,375 %, due 6/1/2024	274	0,18
440	Valvoline Inc, 5,500 %, due 7/15/2024	460	0,30
470	Valvoline Inc, 4,375 %, due 8/15/2025	477	0,31
560	Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, due 9/15/2027	582	0,38
490	Vishay Intertechnology Inc, 2,250 %, due 6/15/2025	456	0,29
500	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, due 2/15/2028	515	0,33
250	Waste Pro USA Inc, 144A, 5,500 %, due 2/15/2026	261	0,17
640	Weight Watchers International Inc, 144A, 8,625 %, due 12/1/2025	645	0,42
430	Western Digital Corp, 4,750 %, due 2/15/2026	441	0,29
400	Whiting Petroleum Corp, 5,750 %, due 3/15/2021	376	0,24
240	William Carter Co/The, 144A, 5,625 %, due 3/15/2027	256	0,17
210	William Lyon Homes Inc, 6,000 %, due 9/1/2023	219	0,14
230	William Lyon Homes Inc, 5,875 %, due 1/31/2025	233	0,15
820	Windstream Services LLC / Windstream Finance Corp, 10,500 %, due 6/30/2024 †ε	513	0,33
400	WPX Energy Inc, 8,250 %, due 8/1/2023	447	0,29
490	WPX Energy Inc, 5,750 %, due 6/1/2026	510	0,33
560	XPO CNW Inc, 6,700 %, due 5/1/2034	552	0,36
670	XPO Logistics Inc, 144A, 6,125 %, due 9/1/2023	694	0,45
		101.170	65,41
Sambia – 0,71 % (28. February 2019: 0,76 %)			
270	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, due 4/1/2023	255	0,17
610	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, due 4/1/2025	561	0,36
320	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, due 3/1/2026	286	0,18
		1.102	0,71
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 127.926)		130.646	84,46
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,83 % (28. Februar 2019: 1,57 %)			
Argentinien – 0,44 % (28. Februar 2019: 1,02 %)			
490	Argentine Republic Government International Bond, 5,625 %, due 1/26/2022	196	0,13
210	Argentine Republic Government International Bond, 7,500 %, due 4/22/2026	82	0,05
300	Argentine Republic Government International Bond, 6,875 %, due 1/26/2027	116	0,07
200	Argentine Republic Government International Bond, 7,625 %, due 4/22/2046	78	0,05
640	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 7,875 %, due 6/15/2027	215	0,14
		687	0,44

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Ecuador – 0,39 % (28. Februar 2019: 0,39 %)			
200	Ecuador Government International Bond, 144A, 8,750 %, due 6/2/2023	210	0,14
410	Ecuador Government International Bond, 144A, 7,875 %, due 1/23/2028	385	0,25
		595	0,39
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 2.470)		1.282	0,83
Schuldscheindarlehen – 7,16 % (28. Februar 2019: 3,21 %)			
59	Allied Universal Holdco LLC, 6,507 %, due 7/12/2026 *	60	0,04
601	Allied Universal Holdco LLC, 6,507 %, due 7/12/2026 *	601	0,39
450	Beta Sub LLC, 6,729 %, due 5/24/2026 *	449	0,29
490	Caesars Resort Collection LLC, 4,984 %, due 12/22/2024 *	483	0,31
650	CEOC LLC, 4,234 %, due 10/6/2024 *	650	0,42
70	Diamond Sports Group LLC, 5,420 %, due 7/18/2026 *	70	0,05
798	Eastern Power LLC, 5,984 %, due 10/2/2023 *	802	0,52
520	Global Tel'Link Corp, 6,484 %, due 11/29/2025 *	498	0,32
356	iHeartCommunications Inc, 6,230 %, due 5/1/2026 *	358	0,23
260	Jane Street Group LLC, 5,234 %, due 8/25/2022 *	259	0,17
480	McAfee LLC, 5,991 %, due 9/29/2024 *	481	0,31
343	Panda Temple Power LLC, 10,269 %, due 2/7/2023 *	344	0,22
340	Panther BF Aggregator 2 LP, 5,734 %, due 3/18/2026 *	335	0,22
1.211	PetSmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022 *	1.176	0,76
480	Phoenix Guarantor Inc, 6,744 %, due 3/5/2026 *	478	0,31
475	Pisces Midco Inc, 5,951 %, due 3/29/2025 *	463	0,30
400	Prime Security Services Borrower LLC, 4,984 %, due 5/2/2022 *	400	0,26
674	Radnet Management Inc, 5,830 %, due 7/1/2023 *	672	0,43
559	RegionalCare Hospital Partners Holding, 6,769 %, due 11/16/2025 *	555	0,36
470	Spencer Spirit IH LLC, 8,182 %, due 6/14/2026 *	464	0,30
242	Toms Shoes LLC, 7,760 %, due 10/31/2020 *	177	0,11
810	U.S. Renal Care Inc, 7,250 %, due 6/14/2026 *	777	0,50
520	VVC Holding Corp, 6,701 %, due 2/11/2026 *	518	0,34
Loan Notes insgesamt (Anschaffungskosten USD 11.055)		11.070	7,16
Investmentfonds – 4,57 % (28. Februar 2019: 0,65 %)			
7.075	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	7.075	4,57
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 7.075)		7.075	4,57
Stammaktien – 1,03 % (28. Februar 2019: 2,10 %)			
USA – 1,03 % (28. Februar 2019: 2,10 %)			
115	Berry Petroleum Corp	917	0,59
96	Hercules Offshore Inc †∞	62	0,04
30	Montage Resources Corp	89	0,06
1	MWO Holdings Ltd †∞	55	0,03
22	New Common Shares Panda †	478	0,31
		1.601	1,03
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 4.358)		1.601	1,03
Vorzugsaktien – 0,71 % (28. Februar 2019: 0,37 %)			
USA – 0,71 % (28. Februar 2019: 0,37 %)			
7	B. Riley Financial Inc †	174	0,11
35	GMAC Capital Trust I, Series 2	918	0,60
		1.092	0,71
Vorzugsaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 1.091)		1.092	0,71
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 161.421)		159.876	103,36
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		–	–
Futures – 0,01 % (28. Februar 2019: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		5	0,01
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		159.881	103,37
Devisenterminkontrakte – 0,03 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(43)	(0,03)
Futures – (0,01 %) (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(12)	(0,01)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(55)	(0,04)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten		159.826	103,33
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(5.145)	(3,33)
Nettovermögen insgesamt		USD 154.681	100,00

– Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Registrierung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 31. August 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 79.301.000 oder 51,27 % des Nettovermögens,

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

† Illiquide.

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

ε Für das Wertpapier besteht am 31. August 2019 Zahlungsausfall.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. 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	86,36
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	6,75
Investmentfonds	4,31
Derivate	–
Sonstige Vermögenswerte	2,58
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	EUR	5	USD	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	46	Verkauf	SGD	62		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	79	Verkauf	USD	97		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	10	Verkauf	USD	12		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.002	Verkauf	USD	2.244		(41)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	535	Verkauf	USD	387		(2)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 11)									–
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)									(43)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 11)								USD	(43)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
U.S. 5 Year Note (CBT) December 2019	24	USD 2.879	USD	5
U.S. Long Bond (CBT) December 2019	(18)	(2.974)		(12)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 19)			USD	5
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (1))				(12)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 18)			USD	(7)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 52,47 % (28. Februar 2019: 53,98 %)			
Argentinien – 0,85 % (28. Februar 2019: 2,95 %)			
200	Pampa Energia SA, 7,500 %, due 1/24/2027	128	0,60
150	YPF SA, 51,625 %, due 7/7/2020 *	31	0,14
ARS 3.200	YPF SA, 16,500 %, due 5/9/2022	22	0,11
		181	0,85
Brasilien – 4,09 % (28. Februar 2019: 4,27 %)			
200	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 6,125 %, Perpetual *	202	0,95
150	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, due 3/17/2024	167	0,79
100	Petrobras Global Finance BV, 5,299 %, due 1/27/2025	108	0,51
160	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, due 6/5/2115	179	0,84
200	Ultrapar International SA, 5,250 %, due 10/6/2026	213	1,00
		869	4,09
Chile – 2,31 % (28. Februar 2019: 1,90 %)			
150	Enel Chile SA, 4,875 %, due 6/12/2028	168	0,79
301	GNL Quintero SA, 144A, 4,634 %, due 7/31/2029	324	1,52
		492	2,31
China – 5,88 % (28. Februar 2019: 6,79 %)			
200	China Aoyuan Group Ltd, 6,350 %, due 1/11/2020	201	0,94
200	China SCE Group Holdings Ltd, 8,750 %, due 1/15/2021	206	0,97
200	Chinalco Capital Holdings Ltd, 4,000 %, due 8/25/2021	200	0,94
240	Country Garden Holdings Co Ltd, 7,500 %, due 3/9/2020	244	1,15
200	Longfor Group Holdings Ltd, 3,900 %, due 4/16/2023	205	0,97
200	Yuzhou Properties Co Ltd, 6,000 %, due 1/25/2022	193	0,91
		1.249	5,88
Kolumbien – 4,76 % (28. Februar 2019: 3,05 %)			
220	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA, 4,875 %, due 4/21/2025	235	1,11
200	Ecopetrol SA, 4,125 %, due 1/16/2025	210	0,99
200	Millicom International Cellular SA, 6,250 %, due 3/25/2029	218	1,02
300	Transportadora de Gas Internacional SA ESP, 5,550 %, due 11/1/2028	349	1,64
		1.012	4,76
Hongkong – 0,93 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
200	Radiant Access Ltd,4,600 %, Perpetual	197	0,93
Indonesien – 3,62 % (28. Februar 2019: 6,50 %)			
200	Chandra Asri Petrochemical Tbk PT, 4,950 %, due 11/8/2024	194	0,91
IDR 2.000.000	Jasa Marga Persero Tbk PT, 7,500 %, due 12/11/2020	138	0,65
200	Minejesa Capital BV, 5,625 %, due 8/10/2037	223	1,05
200	Perusahaan Listrik Negara PT, 4,125 %, due 5/15/2027	214	1,01
		769	3,62
Irland – 0,51 % (28. Februar 2019: 0,43 %)			
100	Park Aerospace Holdings Ltd, 5,500 %, due 2/15/2024	108	0,51
Italien – 1,06 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
200	UniCredit SpA, 7,296 %, due 4/2/2034 *	226	1,06
Kasachstan – 3,18 % (28. Februar 2019: 2,49 %)			
200	KazMunayGas National Co JSC, 6,375 %, due 10/24/2048	253	1,19
400	KazTransGas JSC, 4,375 %, due 9/26/2027	422	1,99
		675	3,18
Macau – 1,05 % (28. Februar 2019: 0,84 %)			
200	Sands China Ltd, 5,125 %, due 8/8/2025	222	1,05
Mexiko – 3,22 % (28. Februar 2019: 3,53 %)			
200	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 7,625 %, Perpetual *	201	0,95
200	BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, due 1/18/2033 *	192	0,90
280	Cemex SAB de CV, 144A, 6,125 %, due 5/5/2025	291	1,37
		684	3,22
Marokko – 1,00 % (28. Februar 2019: 0,82 %)			
200	OCP SA, 4,500 %, due 10/22/2025	213	1,00
Peru – 1,80 % (28. Februar 2019: 3,05 %)			
200	Kallpa Generacion SA, 4,125 %, due 8/16/2027	209	0,98
150	Southern Copper Corp, 5,250 %, due 11/8/2042	173	0,82
		382	1,80
Katar – 0,96 % (28. Februar 2019: 0,82 %)			
200	ABQ Finance Ltd, 3,500 %, due 2/22/2022	204	0,96
Russland – 5,35 % (28. Februar 2019: 5,27 %)			
320	Lukoil International Finance BV, 6,656 %, due 6/7/2022	354	1,66
700	Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital SA, 8,500 %, due 10/16/2023	783	3,69
		1.137	5,35
Singapur – 1,99 % (28. Februar 2019: 0,84 %)			
200	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, due 6/19/2024	214	1,01
200	United Overseas Bank Ltd, 3,750 %, due 4/15/2029 *	208	0,98
		422	1,99
Südafrika – 1,24 % (28. Februar 2019: 0,99 %)			
230	Myriad International Holdings BV, 5,500 %, due 7/21/2025	262	1,24
Türkei – 2,88 % (28. Februar 2019: 2,51 %)			
220	TC Ziraat Bankasi AS, 4,750 %, due 4/29/2021	215	1,01
200	TC Ziraat Bankasi AS, 5,125 %, due 5/3/2022	189	0,89
220	Turk Telekomunikasyon AS, 4,875 %, due 6/19/2024	209	0,98
		613	2,88
Vereinigte Arabische Emirate - 5,79 % (28. Februar 2019: 4,74 %)			
200	Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 4,875 %, due 4/23/2030	232	1,09
90	DAE Funding LLC, 5,000 %, due 8/1/2024	95	0,44
200	DP World Plc, 5,625 %, due 9/25/2048	239	1,13
450	First Abu Dhabi Bank PJSC, 5,250 %, Perpetual *	456	2,15
200	MDC-GMTN BV, 3,000 %, due 4/19/2024	208	0,98
		1.230	5,79
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 10.779)		11.147	52,47
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 31,71 % (28. Februar 2019: 33,96 %)			
Angola – 1,07 % (28. Februar 2019: 1,82 %)			
200	Angolan Government International Bond, 9,500 %, due 11/12/2025	227	1,07
Argentinien – 2,71 % (28. Februar 2019: 6,02 %)			
ARS 300	Argentina Bonar Bonds, 54,553 %, due 4/3/2022 *	2	0,01
ARS 5.440	Argentina POM Politica Monetaria, Serie POM, 66,777 %, due 6/21/2020 *	31	0,15
ARS 4.500	Argentina Treasury Bill, zero coupon, fällig 7/29/2020	50	0,24
160	Argentine Republic Government International Bond, 7,500 %, due 4/22/2026	63	0,29
130	Argentine Republic Government International Bond, 3,750 %, due 12/31/2038	47	0,22
110	Argentine Republic Government International Bond, 7,125 %, due 6/28/2117	43	0,20
300	Ciudad Autonoma De Buenos Aires/Government Bonds, 7,500 %, due 6/1/2027	197	0,93
390	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 9,950 %, due 6/9/2021	143	0,67
		576	2,71
Bahrain – 1,07 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
200	Bahrain Government International Bond, 6,750 %, due 9/20/2029	227	1,07
Brasilien – 1,73 % (28. Februar 2019: 1,38 %)			
BRL 1.200	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2021	305	1,44
BRL 230	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2025	63	0,29
		368	1,73
Kolumbien – 1,18 % (28. Februar 2019: 0,85 %)			
200	Colombia Government International Bond, 5,200 %, due 5/15/2049	251	1,18
Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,45 % (28. Februar 2019: 1,16 %)			
97	Ivory Coast Government International Bond, 5,750 %, due 12/31/2032	96	0,45
Dominikanische Republik – 1,08 % (28. Februar 2019: 0,86 %)			
200	Dominican Republic International Bond, 144A, 6,850 %, due 1/27/2045	229	1,08
Ecuador – 0,88 % (28. Februar 2019: 1,69 %)			
200	Ecuador Government International Bond, 7,875 %, due 1/23/2028	188	0,88

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Ägypten – 2,44 % (28. Februar 2019: 3,10 %)			
260	Egypt Government International Bond, 7,903 %, due 2/21/2048	269	1,27
EGP 2.775	Egypt Treasury Bills, zero coupon, due 10/1/2019	167	0,79
EGP 1.425	Egypt Treasury Bills, zero coupon, due 1/21/2020	81	0,38
		517	2,44
Ghana – 2,72 % (28. Februar 2019: 2,30 %)			
380	Ghana Government International Bond, 10,750 %, due 10/14/2030	474	2,23
GHS 360	Republic of Ghana Government Bonds, Serie 5Y, 18,250 %, due 7/25/2022	65	0,31
GHS 220	Republic of Ghana Government Bonds, 17,600 %, due 11/28/2022	39	0,18
		578	2,72
Indonesien – 3,59 % (28. Februar 2019: 4,11 %)			
200	Indonesia Government International Bond, 6,625 %, due 2/17/2037	280	1,32
IDR 340.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR61, 7,000 %, due 5/15/2022	24	0,11
IDR 6.160.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR68, 8,375 %, due 3/15/2034	459	2,16
		763	3,59
Mexiko – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
MXN 10	Mexican Bonos,Series M, 5,750 %, due 3/5/2026	–	–
Nigeria – 1,57 % (28. Februar 2019: 1,33 %)			
200	Nigeria Government International Bond, 6,500 %, due 11/28/2027	200	0,94
NGN 51.860	Nigeria OMO Bill, zero coupon, due 2/20/2020	134	0,63
		334	1,57
Oman – 1,85 % (28. Februar 2019: 0,76 %)			
200	Oman Government International Bond, 4,750 %, due 6/15/2026	195	0,91
200	Oman Government International Bond, 6,000 %, due 8/1/2029	199	0,94
		394	1,85
Katar – 2,25 % (28. Februar 2019: 0,89 %)			
370	Qatar Government International Bond, 4,817 %, due 3/14/2049	477	2,25
Russland – 1,55 % (28. Februar 2019: 1,30 %)			
RUB 9.050	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6209, 7,600 %, due 7/20/2022	139	0,65
RUB 12.619	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, due 1/19/2028	191	0,90
		330	1,55
Senegal – 1,96 % (28. Februar 2019: 1,68 %)			
200	Senegal Government International Bond, 8,750 %, due 5/13/2021	217	1,02
200	Senegal Government International Bond, 6,250 %, due 5/23/2033	198	0,94
		415	1,96
Sri Lanka – 0,95 % (28. Februar 2019: 0,81 %)			
200	Sri Lanka Government International Bond, 5,875 %, due 7/25/2022	200	0,95

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Türkei – 1,05 % (28. Februar 2019: 0,92 %)			
230	Export Credit Bank of Turkey, 5,000 %, due 9/23/2021	224	1,05
Uruguay – 0,58 % (28. Februar 2019: 1,27 %)			
100	Uruguay Government International Bond, 4,975 %, due 4/20/2055	123	0,58
Vietnam – 1,03 % (28. Februar 2019: 0,86 %)			
200	Vietnam Government International Bond, 144A, 4,800 %, due 11/19/2024	218	1,03
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 7.408)		6.735	31,71
Investmentfonds - 10,10 % (28. Februar 2019: 10,19 %)			
22	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – Klasse LM USD ausschüttend (M)	2.145	10,10
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 1.993)		2.145	10,10
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 20.180)		20.027	94,28

Kontrakte (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Gekaufte Optionen – 0,12 % (28. Februar 2019: 0,08 %)			
EUR 500	EUR Put/USD Call 1,15, due 10/22/2019	24	0,11
250	USD Put/COP Call 3.050,00, due 9/3/2019	–	–
225	USD Put/IDR Call 14.000,00, due 1/15/2020	1	0,01
620	USD Put/INR Call 68,50, due 1/14/2020	1	–
250	USD Put/INR Call 69,20, due 9/24/2019	–	–
Gekaufte Optionen insgesamt (Anschaffungskosten USD 26)		26	0,12
Devisenterminkontrakte – 0,41 % (28. Februar 2019: 0,05 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		(87)	0,41
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		20.140	94,81
Verkaufte Optionen – (0,16 %) (28. Februar 2019: 0,06 %))			
EUR (500)	EUR Call/USD Put 1,22, due 10/22/2019	–	–
(250)	USD Call/COP Put 3.250,00, due 9/3/2019	(14)	(0,06)
(225)	USD Call/IDR Put 15.000,00, due 1/15/2020	(2)	(0,01)
(250)	USD Call/INR Put 71,50, due 9/24/2019	(3)	(0,01)
(620)	USD Call/INR Put 71,70, due 1/14/2020	(16)	(0,08)
(250)	USD Put/COP Call 2.950,00, due 9/3/2019	–	–
Veräußerte Optionen gesamt (Anschaffungskosten USD (28))		(35)	(0,16)
Devisenterminkontrakte – (0,46 %) (28. Februar 2019: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(97)	(0,46)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Futures – (0,04 %) (28. Februar 2019: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(9)	(0,04)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	(141)	(0,66)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	19.999	94,15
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	1.244	5,85
Nettovermögen insgesamt	USD 21.243	100,00

– Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, 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 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 1.062.000 und machten 5,00 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

Die Gegenparteien für OTC-Optionen sind Barclays, Citi und JP Morgan.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual	– Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen
ARS	– Argentinischer Peso
BRL	– Brasilianischer Real
EGP	– Ägyptisches Pfund
EUR	– Euro
GHS	– Ghanaischer Cedi
IDR	– Indonesische Rupiah
MXN	– Mexikanischer Peso
NGN	– Nigerianischer Naira
RUB	– Russischer Rubel

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	82,99
Investmentfonds	9,96
Derivate	0,52
Sonstige Vermögenswerte	6,53
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	66	Verkauf	EUR	58	USD	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	–		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	SGD	5		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.645	Verkauf	USD	1.850		(38)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	65	Verkauf	USD	79		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	USD	–		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	166	Verkauf	USD	120		(1)
13.09.19	Citi	Kauf	USD	186	Verkauf	ARS	9.741		28
13.09.19	Citi	Kauf	ARS	4.911	Verkauf	USD	102		(23)
13.09.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	129	Verkauf	ARS	8.333		(6)
13.09.19	JP Morgan	Kauf	USD	229	Verkauf	COP	782.461		2
15.10.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	71	Verkauf	RUB	4.556		3
15.10.19	Barclays	Kauf	USD	135	Verkauf	INR	9.754		–
15.10.19	Barclays	Kauf	USD	508	Verkauf	INR	36.498		3
15.10.19	Citi	Kauf	USD	76	Verkauf	ARS	3.590		24
15.10.19	Citi	Kauf	ARS	3.590	Verkauf	USD	76		(24)
15.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	419	Verkauf	BRL	1.630		26
15.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	527	Verkauf	IDR	7.580.348		(4)
14.11.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	871	Verkauf	SAR	3.270		(1)
14.11.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	SAR	1.242	Verkauf	USD	331		–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 11)									87
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (2))									(97)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 9)								USD	(10)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
U.S. 10 Year Note (CBT) December 2019	(17)	USD (2.239)	USD	(9)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 6)			USD	–
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)				(9)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 6)			USD	(9)

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 90,04 % (28. Februar 2019: 85,83 %)			
Argentinien – 0,80 % (28. Februar 2019: 2,01 %)			
160	Pampa Energia SA, 7,500 %, due 1/24/2027	103	0,28
210	YPF SA, 8,500 %, due 3/23/2021	162	0,45
ARS 3.850	YPF SA, 16,500 %, due 5/9/2022	27	0,07
		292	0,80
Brasilien – 14,34 % (28. Februar 2019: 14,12 %)			
270	Braskem Finance Ltd, 5,375 %, due 5/2/2022	282	0,78
200	Gerdau Trade Inc, 4,875 %, due 10/24/2027	214	0,59
400	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 5,650 %, due 3/19/2022	420	1,15
500	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 6,125 %, Perpetual *	505	1,39
960	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, due 3/17/2024	1.071	2,94
300	Petrobras Global Finance BV, 5,999 %, due 1/27/2028	331	0,91
280	Petrobras Global Finance BV, 6,900 %, due 3/19/2049	318	0,88
760	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, due 6/5/2115	850	2,34
200	Suzano Austria GmbH, 5,750 %, due 7/14/2026	224	0,61
200	Suzano Austria GmbH, 6,000 %, due 1/15/2029	222	0,61
400	Ultrapar International SA, 5,250 %, due 10/6/2026	425	1,17
280	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, due 11/10/2039	355	0,97
		5.217	14,34
Chile – 4,05 % (28. Februar 2019: 2,73 %)			
400	Enel Chile SA, 4,875 %, due 6/12/2028	447	1,23
200	GNL Quintero SA, 4,634 %, due 7/31/2029	215	0,59
200	Inversiones CMPC SA, 4,750 %, due 9/15/2024	216	0,59
350	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 4,250 %, due 5/7/2029	380	1,05
200	Transelec SA, 4,625 %, due 7/26/2023	214	0,59
		1.472	4,05
China – 10,58 % (28. Februar 2019: 8,79 %)			
200	China Aoyuan Group Ltd, 7,950 %, due 9/7/2021	207	0,57
250	China Overseas Finance Cayman III Ltd, 5,375 %, due 10/29/2023	277	0,76
200	China SCE Group Holdings Ltd, 8,750 %, due 1/15/2021	206	0,57
200	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 4,625 %, due 3/14/2023	211	0,58
200	CNOOC Curtis Funding No 1 Pty Ltd, 4,500 %, due 10/3/2023	216	0,59
370	CNOOC Finance 2012 Ltd, 3,875 %, due 5/2/2022	384	1,05
200	CNOOC Finance 2015 USA LLC, 3,500 %, due 5/5/2025	210	0,58
310	Country Garden Holdings Co Ltd, 7,500 %, due 3/9/2020	315	0,87
300	ICBCIL Finance Co Ltd, 3,250 %, due 3/17/2020	301	0,83
250	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/ New York NY, 2,957 %, due 11/8/2022	253	0,70
200	Longfor Group Holdings Ltd, 3,900 %, due 4/16/2023	205	0,56
190	Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, due 11/12/2023	206	0,56
200	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 4,125 %, due 9/12/2025	218	0,60
400	Tencent Holdings Ltd, 3,925 %, due 1/19/2038	436	1,20
200	Yuzhou Properties Co Ltd, 7,900 %, due 5/11/2021	204	0,56
		3.849	10,58
Kolumbien – 4,80 % (28. Februar 2019: 5,30 %)			
200	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA, 4,875 %, due 4/21/2025	214	0,59
400	Ecopetrol SA, 5,875 %, due 5/28/2045	472	1,29
200	Grupo de Inversiones Suramericana SA, 5,500 %, due 4/29/2026	224	0,61
200	Millicom International Cellular SA, 6,250 %, due 3/25/2029	218	0,60
150	SURA Asset Management SA, 4,375 %, due 4/11/2027	157	0,43
400	Transportadora de Gas Internacional SA ESP, 5,550 %, due 11/1/2028	464	1,28
		1.749	4,80
Hongkong – 6,58 % (28. Februar 2019: 6,68 %)			
400	Bank of East Asia Ltd/The, 4,250 %, due 11/20/2024 *	401	1,10
500	Goodman HK Finance, 4,375 %, due 6/19/2024	532	1,46
760	Hutchison Whampoa International 14 Ltd, 3,625 %, due 10/31/2024	801	2,20
400	Melco Resorts Finance Ltd, 4,875 %, due 6/6/2025	398	1,10
250	Swire Properties MTN Financing Ltd, 4,375 %, due 6/18/2022	263	0,72
		2.395	6,58
Indien – 2,52 % (28. Februar 2019: 2,80 %)			
200	ICICI Bank Ltd/Dubai, 4,000 %, due 3/18/2026	210	0,58
200	Oil India Ltd, 5,375 %, due 4/17/2024	222	0,61
204	ONGC Videsh Ltd, 4,625 %, due 7/15/2024	220	0,60
250	Reliance Industries Ltd, 3,667 %, due 11/30/2027	264	0,73
		916	2,52
Indonesien – 3,30 % (28. Februar 2019: 2,92 %)			
260	Chandra Asri Petrochemical Tbk PT, 4,950 %, due 11/8/2024	252	0,69
200	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 5,710 %, due 11/15/2023	222	0,61
200	Listrindo Capital BV, 4,950 %, due 9/14/2026	202	0,56
230	Minejesa Capital BV, 5,625 %, due 8/10/2037	256	0,70
250	Perusahaan Listrik Negara PT, 4,125 %, due 5/15/2027	268	0,74
		1.200	3,30
Irland – 0,57 % (28. Februar 2019: 0,94 %)			
200	Park Aerospace Holdings Ltd, 4,500 %, due 3/15/2023	207	0,57
Israel — 1,25 % (February 28, 2019: 1,78 %)			
300	Teva Pharmaceutical Finance IV BV, 3,650 %, due 11/10/2021	286	0,79
200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, due 7/21/2023	169	0,46
		455	1,25
Kasachstan – 2,49 % (28. Februar 2019: 2,16 %)			
200	KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, due 4/24/2030	232	0,64
200	KazMunayGas National Co JSC, 6,375 %, due 10/24/2048	253	0,69
400	KazTransGas JSC, 4,375 %, due 9/26/2027	423	1,16
		908	2,49
Kuwait – 1,15 % (28. Februar 2019: 1,05 %)			
200	Equate Petrochemical BV, 4,250 %, due 11/3/2026	217	0,60
200	NBK SPC Ltd, 2,750 %, due 5/30/2022	202	0,55
		419	1,15
Macau – 1,20 % (28. Februar 2019: 0,54 %)			
200	MGM China Holdings Ltd, 5,375 %, due 5/15/2024	207	0,57
200	Sands China Ltd, 5,400 %, due 8/8/2028	231	0,63
		438	1,20
Malaysia – 1,14 % (28. Februar 2019: 1,04 %)			
200	CIMB Bank Bhd, 3,263 %, due 3/15/2022	204	0,56
200	Gohl Capital Ltd, 4,250 %, due 1/24/2027	212	0,58
		416	1,14
Mexiko – 4,06 % (28. Februar 2019: 3,77 %)			
200	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 6,875 %, Perpetual *	199	0,55
200	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 7,500 %, Perpetual *	200	0,55
200	BBVA Bancomer SA/Texas, 6,750 %, due 9/30/2022	216	0,59
250	BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, due 1/18/2033 *	240	0,66
200	Cemex SAB de CV, 6,125 %, due 5/5/2025	208	0,57
200	Grupo Bimbo SAB de CV, 3,875 %, due 6/27/2024	210	0,58
200	Mexichem SAB de CV, 4,000 %, due 10/4/2027	205	0,56
		1.478	4,06
Marokko – 1,34 % (28. Februar 2019: 1,23 %)			
250	OCP SA, 5,625 %, due 4/25/2024	276	0,76
200	OCP SA, 4,500 %, due 10/22/2025	212	0,58
		488	1,34
Panama – 0,55 % (28. Februar 2019: 0,52 %)			
200	Banistmo SA, 3,650 %, due 9/19/2022	201	0,55
Peru – 4,48 % (28. Februar 2019: 4,02 %)			
200	Banco BBVA Peru SA, 5,250 %, due 9/22/2029 *	217	0,60
200	Consorcio Transmantaro SA, 4,700 %, due 4/16/2034	219	0,60
200	Kallpa Generacion SA, 4,125 %, due 8/16/2027	209	0,57
240	Nexa Resources Peru SAA, 4,625 %, due 3/28/2023	250	0,69
105	Southern Copper Corp, 7,500 %, due 7/27/2035	142	0,39
220	Southern Copper Corp, 5,875 %, due 4/23/2045	274	0,75

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Peru – (Fortsetzung)			
300	Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, due 4/30/2028	321	0,88
		1.632	4,48
Katar – 1,36 % (28. Februar 2019: 1,26 %)			
200	ABQ Finance Ltd, 3,500 %, due 2/22/2022	204	0,56
250	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3, 5,838 %, due 9/30/2027	291	0,80
		495	1,36
Russland – 3,48 % (28. Februar 2019: 3,23 %)			
570	Lukoil International Finance BV, 6,656 %, due 6/7/2022	630	1,73
200	Lukoil International Finance BV, 4,563 %, due 4/24/2023	212	0,58
200	Lukoil International Finance BV, 4,750 %, due 11/2/2026	218	0,60
200	MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC, 4,100 %, due 4/11/2023	207	0,57
		1.267	3,48
Singapur – 4,11 % (28. Februar 2019: 3,46 %)			
400	BOC Aviation Ltd, 2,750 %, due 9/18/2022	401	1,10
200	DBS Group Holdings Ltd, 4,520 %, due 12/11/2028 *	214	0,59
530	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, due 6/19/2024	566	1,56
300	United Overseas Bank Ltd, 3,750 %, due 4/15/2029 *	313	0,86
		1.494	4,11
Südafrika – 1,25 % (28. Februar 2019: 1,64 %)			
200	Myriad International Holdings BV, 5,500 %, due 7/21/2025	228	0,63
200	Myriad International Holdings BV, 4,850 %, due 7/6/2027	228	0,62
		456	1,25
Südkorea – 4,57 % (28. Februar 2019: 4,16 %)			
200	GS Caltex Corp, 3,000 %, due 6/12/2022	203	0,56
200	Hyundai Capital Services Inc, 3,000 %, due 3/6/2022	202	0,55
330	KEB Hana Bank, 4,250 %, due 10/14/2024	353	0,97
200	Kia Motors Corp, 3,000 %, due 4/25/2023	203	0,56
660	Shinhan Bank Co Ltd, 3,875 %, due 3/24/2026	701	1,93
		1.662	4,57
Thailand – 0,63 % (28. Februar 2019: 0,55 %)			
200	Thaioil Treasury Center Co Ltd, 4,625 %, due 11/20/2028	231	0,63
Türkei – 2,10 % (28. Februar 2019: 2,52 %)			
200	TC Ziraat Bankasi AS, 4,750 %, due 4/29/2021	195	0,54
200	TC Ziraat Bankasi AS, 5,125 %, due 5/3/2022	189	0,52
400	Turk Telekomunikasyon AS, 4,875 %, due 6/19/2024	380	1,04
		764	2,10
Vereinigte Arabische Emirate - 5,96 % (28. Februar 2019: 5,11 %)			
400	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 4,600 %, due 11/2/2047	496	1,36
500	Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 4,875 %, due 4/23/2030	580	1,59
200	DAE Funding LLC, 5,000 %, due 8/1/2024	210	0,58
200	DP World Plc, 6,850 %, due 7/2/2037	271	0,74
300	DP World Plc, 5,625 %, due 9/25/2048	358	0,99
250	First Abu Dhabi Bank PJSC, 5,250 %, Perpetual *	253	0,70
		2.168	5,96
USA – 1,38 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
490	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, due 8/8/2024	501	1,38
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 31.050)		32.770	90,04
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 9,40 % (28. Februar 2019: 9,54 %)			
Argentinien – 0,68 % (28. Februar 2019: 1,63 %)			
ARS 200	Argentina Bonar Bonds, 54,553 %, due 4/3/2022 *	1	–
ARS 5.710	Argentina POM Politica Monetaria, Serie POM, 66,777 %, due 6/21/2020 *	33	0,09
ARS 4,000	Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER, 4,000 %, due 3/6/2020 β	50	0,14
150	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 9,125 %, due 3/16/2024	49	0,14
200	Provincia de Neuquen Argentina, 7,500 %, due 4/27/2025	114	0,31
		247	0,68
Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,52 % (28. Februar 2019: 0,49 %)			
200	Ivory Coast Government International Bond, 6,125 %, due 6/15/2033	190	0,52
Ecuador – 0,61 % (28. Februar 2019: 0,58 %)			
210	Ecuador Government International Bond, 8,750 %, due 6/2/2023	221	0,61
Ägypten – 1,00 % (28. Februar 2019: 0,94 %)			
200	Egypt Government International Bond, 6,125 %, due 1/31/2022	208	0,57
EGP 2.700	Egypt Treasury Bills, zero coupon, due 1/21/2020	155	0,43
		363	1,00
El Salvador – 0,56 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
200	El Salvador Government International Bond, 7,125 %, due 1/20/2050	205	0,56
Ghana – 0,60 % (28. Februar 2019: 0,56 %)			
200	Ghana Government International Bond, 7,875 %, due 8/7/2023	218	0,60
Indien – 1,13 % (28. Februar 2019: 1,00 %)			
400	Export-Import Bank of India, 3,375 %, due 8/5/2026	413	1,13
Kenia – 0,59 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
200	Kenya Government International Bond, 6,875 %, due 6/24/2024	214	0,59
Nigeria – 0,57 % (28. Februar 2019: 0,55 %)			
200	Nigeria Government International Bond, 7,875 %, due 2/16/2032	206	0,57
Oman – 0,55 % (28. Februar 2019: 0,51 %)			
200	Oman Government International Bond, 4,125 %, due 1/17/2023	200	0,55
Katar – 1,47 % (28. Februar 2019: 1,15 %)			
400	Qatar Government International Bond, 5,103 %, due 4/23/2048	534	1,47
Senegal – 0,54 % (28. Februar 2019: 0,51 %)			
200	Senegal Government International Bond, 6,250 %, due 5/23/2033	198	0,54
Ukraine – 0,58 % (28. Februar 2019: 0,50 %)			
200	Ukraine Government International Bond, 7,750 %, due 9/1/2025	213	0,58
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 3.928)		3.422	9,40
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 34.978)		36.192	99,44

Kontrakte (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Gekaufte Optionen – 0,09 % (28. Februar 2019: 0,04 %)			
EUR 700	EUR Put/USD Call 1,15, fällig 10/22/2019	34	0,09
Gekaufte Optionen insgesamt (Anschaffungskosten USD 14)		34	0,09
Devisenterminkontrakte – 0,20 % (28. Februar 2019: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		73	0,20
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		36.299	99,73
Verkaufte Optionen – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,01 %)			
EUR (700)	EUR Call/USD Put 1,22, fällig 10/22/2019	–	–
Veräußerte Optionen gesamt (Anschaffungskosten USD (15))		–	–
Devisenterminkontrakte – (0,14 %) (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(49)	(0,14)
Futures – (0,03 %) (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(10)	(0,03)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert finanzielle Verbindlichkeiten		(59)	(0,17)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete bewertete finanzielle Vermögenswerte		36.240	99,56
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		155	0,44
Gesamtnettovermögen		USD 36.395	100,00

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

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019. Bei dem Kontrahenten der OTC-Optionen handelt es sich um JP Morgan.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen

ARS – Argentinischer Peso

EGP – Ägyptisches Pfund

EUR – Euro

Analyse des Gesamtvermögens	%von Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,26
Derivate	0,28
Sonstige Vermögenswerte	4,46
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht Realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) Kontrakte (in Tsd.)
13.09.19	Citi	Kauf	USD	175	Verkauf	ARS	9.187		USD 27
13.09.19	Citi	Kauf	ARS	9.187	Verkauf	USD	191		(42)
13.09.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	122	Verkauf	ARS	7.908		(6)
15.10.19	Citi	Kauf	USD	148	Verkauf	ARS	6.985		46
14.11.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	721	Verkauf	SAR	2.708		(1)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 4)									73
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)									(49)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 4)									USD 24

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn- wert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) December 2019	(13)	USD (1.712)	USD (7)
U.S. Long Bond (CBT) December 2019	(4)	(661)	(3)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 6)			USD –
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)			(10)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 6)			USD (10)

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 58,98 % (28. Februar 2019: 60,24 %)			
Argentinien – 1,57 % (28. Februar 2019: 2,30 %)			
410	Pampa Energia SA, 144A, 7,500 %, due 1/24/2027	262	0,26
1.090	Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, due 5/2/2025	818	0,80
780	YPF SA, 144A, 8,500 %, due 7/28/2025	515	0,51
		1.595	1,57
Brasilien – 4,42 % (28. Februar 2019: 4,67 %)			
400	Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 4,500 %, due 1/10/2028	401	0,40
350	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 5,650 %, due 3/19/2022	367	0,36
860	Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, due 1/17/2027	1.023	1,01
620	Petrobras Global Finance BV, 5,999 %, due 1/27/2028	683	0,68
1.580	Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, due 2/1/2029	1.715	1,69
270	Ultrapar International SA, 144A, 5,250 %, due 10/6/2026	287	0,28
		4.476	4,42
Kanada – 1,54 % (28. Februar 2019: 1,88 %)			
290	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,250 %, due 5/15/2024	300	0,30
GBP 100	Entertainment One Ltd, 4,625 %, due 7/15/2026	133	0,13
390	GFL Environmental Inc, 144A, 5,375 %, due 3/1/2023	394	0,39
110	MEG Energy Corp, 144A, 6,375 %, due 1/30/2023	104	0,10
660	MEG Energy Corp, 144A, 7,000 %, due 3/31/2024	631	0,62
		1.562	1,54
Kolumbien – 0,51 % (28. Februar 2019: 1,13 %)			
490	Ecopetrol SA, 4,125 %, due 1/16/2025	515	0,51
Frankreich – 1,30 % (28. Februar 2019: 3,07 %)			
1.230	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, due 5/1/2026	1.316	1,30
Deutschland – 0,62 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
610	Mercer International Inc, 7,375 %, due 1/15/2025	630	0,62
Indonesien – 0,87 % (28. Februar 2019: 0,85 %)			
460	Minejesa Capital BV, 144A, 4,625 %, due 8/10/2030	485	0,48
370	Perusahaan Listrik Negara PT, 5,500 %, due 11/22/2021	394	0,39
		879	0,87
Irland – 1,01 % (28. Februar 2019: 0,80 %)			
980	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 6,000 %, due 2/15/2025	1.026	1,01
Israel – 2,87 % (28. Februar 2019: 1,05 %)			
150	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, due 12/18/2022	131	0,13
EUR 280	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, due 10/15/2024	238	0,24
3.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, due 7/21/2023	2.535	2,50
		2.904	2,87
Italien – 2,74 % (28. Februar 2019: 2,68 %)			
400	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, due 6/26/2024	410	0,41
1.520	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, due 1/15/2026	1.605	1,58
100	Telecom Italia Capital SA, 7,200 %, due 7/18/2036	112	0,11
EUR 190	Telecom Italia Finance SA, 7,750 %, due 1/24/2033	312	0,31
300	UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, due 4/2/2034 *	339	0,33
		2.778	2,74
Luxemburg – 1,97 % (28. Februar 2019: 2,78 %)			
293	Altice Luxembourg SA, 144A, 7,750 %, due 5/15/2022	301	0,30
440	Altice Luxembourg SA, 144A, 10,500 %, due 5/15/2027	479	0,47
929	ARD Securities Finance SARL, 144A, 8,750 %, due 1/31/2023	966	0,95
275	Intelsat Jackson Holdings SA, 5,500 %, due 8/1/2023	252	0,25
		1.998	1,97
Mexiko – 0,98 % (28. Februar 2019: 1,06 %)			
1.030	BBVA Bancomer SA/ Texas, 144A, 5,125 %, due 1/18/2033 *	990	0,98
Niederlande – 1,50 % (28. Februar 2019: 0,92 %)			
EUR 800	Maxeda DIY Holding BV, 6,125 %, due 7/15/2022	864	0,85
630	UPCB Finance IV Ltd, 144A, 5,375 %, due 1/15/2025	652	0,65
		1.516	1,50
Peru – 0,79 % (28. Februar 2019: 0,62 %)			
750	Transportadora de Gas del Peru SA, 144A, 4,250 %, due 4/30/2028	803	0,79
Russland – 0,65 % (28. Februar 2019: 0,91 %)			
600	Lukoil International Finance BV, 144A, 4,750 %, due 11/2/2026	655	0,65
Spanien – 0,12 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
EUR 280	Lecta SA, 6,500 %, due 8/1/2023	124	0,12
Schweiz – 0,49 % (28. Februar 2019: 0,39 %)			
470	UBS Group Funding Switzerland AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	499	0,49
Türkei – 1,36 % (28. Februar 2019: 1,30 %)			
320	TC Ziraat Bankasi AS, 144A, 5,125 %, due 5/3/2022	302	0,30
500	TC Ziraat Bankasi AS, 144A, 5,125 %, due 9/29/2023	456	0,45
610	Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, due 2/28/2025	622	0,61
		1.380	1,36
Großbritannien – 3,56 % (28. Februar 2019: 2,71 %)			
390	Barclays Bank Plc, 7,625 %, due 11/21/2022	430	0,42
220	Barclays Plc, 5,088 %, due 6/20/2030 *	229	0,23
300	Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual *	312	0,31
GBP 180	IDH Finance Plc, 6,250 %, due 8/15/2022	195	0,19
GBP 510	Marston's Issuer Plc, Serie B1, 3,320 %, due 7/15/2035 *	531	0,52
470	Royal Bank of Scotland Group Plc, 6,000 %, due 12/19/2023	512	0,51
460	Royal Bank of Scotland Group Plc, 8,625 %, Perpetual *	488	0,48
GBP 500	Saga Plc, 3,375 %, due 5/12/2024	543	0,54
349	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, due 5/15/2029	365	0,36
		3.605	3,56
USA – 29,52 % (28. Februar 2019: 30,47 %)			
490	ADIENT GLOBAL HOLDINGS Ltd, 144A, 4,875 %, due 8/15/2026	381	0,38
180	Adient US LLC, 144A, 7,000 %, due 5/15/2026	184	0,18
560	Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 7,000 %, due 9/30/2026	606	0,60
230	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, due 7/15/2026	245	0,24
260	American Axle & Manufacturing Inc, 6,500 %, due 4/1/2027	240	0,24
650	Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, due 4/1/2026	738	0,73
130	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, due 2/15/2026	120	0,12
150	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, due 7/15/2026	148	0,15
270	Carriage Services Inc, 144A, 6,625 %, due 6/1/2026	277	0,27
280	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,000 %, due 2/1/2028	295	0,29
660	Centene Corp, 144A, 5,375 %, due 6/1/2026	707	0,70
1.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,903 %, due 2/1/2024 *	1.016	1,00
330	Chesapeake Energy Corp, 5,500 %, due 9/15/2026	209	0,21
545	Chesapeake Energy Corp, 8,000 %, due 6/15/2027	396	0,39
330	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, due 3/15/2026	318	0,31
350	Citigroup Inc, Serie M, 6,300 %, Perpetual *	372	0,37
360	Cogent Communications Group Inc, 144A, 5,375 %, due 3/1/2022	375	0,37
–	Continental Airlines 2000-1 Klasse B Pass Through Trust, Serie 001B, Klasse B, 8,388 %, due 11/1/2020	–	–
300	CoreCivic Inc, 4,750 %, due 10/15/2027	263	0,26
EUR 320	Cott Corp, 5,500 %, due 7/1/2024	367	0,36
500	CSC Holdings LLC, 144A, 6,625 %, due 10/15/2025	537	0,53
490	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, due 2/1/2029	550	0,54
280	DaVita Inc, 5,000 %, due 5/1/2025	281	0,28

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
740	DISH DBS Corp, 5,875 %, due 11/15/2024	707	0,70
1.470	DISH DBS Corp, 7,750 %, due 7/1/2026	1.448	1,43
340	DISH Network Corp, 2,375 %, due 3/15/2024	298	0,29
860	DISH Network Corp, 3,375 %, due 8/15/2026	794	0,78
300	Freeport-McMoRan Inc, 6,875 %, due 2/15/2023	316	0,31
375	Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, due 11/14/2034	362	0,36
1.550	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, due 3/15/2043	1.422	1,40
400	Greif Inc, 144A, 6,500 %, due 3/1/2027	421	0,42
690	Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, due 5/15/2026	731	0,72
70	HCA Inc, 5,875 %, due 2/15/2026	80	0,08
140	HCA Inc, 5,375 %, due 9/1/2026	156	0,15
480	HCA Inc, 5,625 %, due 9/1/2028	547	0,54
550	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,625 %, due 4/1/2025	569	0,56
160	j2 Cloud Services LLC / j2 Global Co-Obligor Inc, 144A, 6,000 %, due 7/15/2025	169	0,17
310	JB Poindexter & Co Inc, 144A, 7,125 %, due 4/15/2026	319	0,31
300	Lennar Corp, 4,750 %, due 11/29/2027	328	0,32
770	Magellan Health Inc, 4,900 %, due 9/22/2024	773	0,76
199	Match Group Inc, 144A, 5,000 %, due 12/15/2027	210	0,21
250	Navient Corp, 6,750 %, due 6/15/2026	268	0,27
340	Navios Maritime Acquisition Corp / Navios Acquisition Finance US Inc, 144A, 8,125 %, due 11/15/2021	278	0,28
190	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp, 7,500 %, due 11/1/2023	193	0,19
200	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, due 1/15/2023	182	0,18
200	Oasis Petroleum Inc, 144A, 6,250 %, due 5/1/2026	162	0,16
780	Pactiv LLC, 8,375 %, due 4/15/2027	840	0,83
630	Party City Holdings Inc, 144A, 6,625 %, due 8/1/2026	602	0,59
200	PetSmart Inc, 144A, 5,875 %, due 6/1/2025	197	0,19
290	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,250 %, due 4/15/2024	300	0,30
190	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,750 %, due 4/15/2026	199	0,20
70	Range Resources Corp, 5,000 %, due 3/15/2023	62	0,06
1.000	Range Resources Corp, 4,875 %, due 5/15/2025	825	0,82
270	ServiceMaster Co LLC/ The, 144A, 5,125 %, due 11/15/2024	284	0,28
160	Spectrum Brands Inc, 5,750 %, due 7/15/2025	167	0,17
750	Sprint Capital Corp, 6,875 %, due 11/15/2028	833	0,82
580	Sprint Corp, 7,875 %, due 9/15/2023	654	0,65
127	Sprint Corp, 7,125 %, due 6/15/2024	141	0,14
410	Sprint Corp, 7,625 %, due 2/15/2025	460	0,45
550	Standard Industries Inc/NJ, 144A, 4,750 %, due 1/15/2028	555	0,55
300	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5,875 %, due 3/1/2027	305	0,30
600	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,875 %, due 4/15/2026	631	0,62
110	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 6,500 %, due 7/15/2027	120	0,12
150	United Rentals North America Inc, 6,500 %, due 12/15/2026	164	0,16
950	United Rentals North America Inc, 4,875 %, due 1/15/2028	1.000	0,99
705	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, due 2/15/2028	726	0,72
160	WEIGHT WATCHERS International Inc, 144A, 8,625 %, due 12/1/2025	161	0,16
190	Western Digital Corp, 4,750 %, due 2/15/2026	195	0,19
560	Western Midstream Operating LP, 4,650 %, due 7/1/2026	571	0,56
875	Windstream Services LLC / Windstream Finance Corp, 10,500 %, due 6/30/2024 †ε	547	0,54
		29.897	29,52
Sambia – 0,59 % (28. February 2019: 0,65 %)			
610	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, due 5/15/2022	596	0,59
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 58.748)		59.744	58,98
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 25,95 % (28. Februar 2019: 25,10 %)			
Argentinien – 2,12 % (28. Februar 2019: 4,31 %)			
ARS 19.880	Argentina POM Politica Monetaria, Serie POM, 66,777 %, due 6/21/2020 *	114	0,11
1.000	Argentine Republic Government International Bond, 6,875 %, due 4/22/2021	428	0,42
980	Argentine Republic Government International Bond, 7,500 %, due 4/22/2026	383	0,38
1.030	Argentine Republic Government International Bond, 6,875 %, due 1/26/2027	399	0,40
1.090	Argentine Republic Government International Bond, 5,875 %, due 1/11/2028	414	0,41
ARS 3.500	Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER, 4,000 %, due 3/6/2020 β	44	0,04
1.100	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144A, 7,875 %, due 6/15/2027	368	0,36
		2.150	2,12
Brasilien – 4,46 % (28. Februar 2019: 2,93 %)			
BRL 2.808	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2023	744	0,73
BRL 1.286	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2027	356	0,35
2.400	Brazilian Government International Bond, 4,250 %, due 1/7/2025	2.558	2,53
800	Brazilian Government International Bond, 4,625 %, due 1/13/2028	862	0,85
		4.520	4,46
Kolumbien – 0,42 % (28. Februar 2019: 0,34 %)			
400	Colombia Government International Bond, 4,000 %, due 2/26/2024	427	0,42
Costa Rica – 0,26 % (28. Februar 2019: 0,20 %)			
260	Costa Rica Government International Bond, 144A, 7,000 %, due 4/4/2044	263	0,26
Kroatien – 0,29 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
280	Croatia Government International Bond, 144A, 6,625 %, due 7/14/2020	290	0,29
Dominikanische Republik – 0,53 % (28. Februar 2019: 0,42 %)			
500	Dominikanische Republik International Bond, 144A, 5,500 %, due 1/27/2025	534	0,53
Ecuador – 1,21 % (28. Februar 2019: 1,16 %)			
1.215	Ecuador Government International Bond, 7,950 %, due 6/20/2024	1.227	1,21
Ägypten – 0,36 % (28. Februar 2019: 1,06 %)			
350	Egypt Government International Bond, 144A, 5,577 %, due 2/21/2023	362	0,36
El Salvador – 0,20 % (28. Februar 2019: 0,16 %)			
200	El Salvador Government International Bond, 144A, 6,375 %, due 1/18/2027	205	0,20
Ghana – 0,64 % (28. Februar 2019: 0,36 %)			
360	Ghana Government International Bond, 144A, 10,750 %, due 10/14/2030	449	0,44
200	Ghana Government International Bond, 144A, 8,125 %, due 3/26/2032	196	0,20
		645	0,64
Guatemala – 0,59 % (28. Februar 2019: 0,45 %)			
570	Guatemala Government Bond, 144A, 4,375 %, due 6/5/2027	593	0,59
Honduras – 0,59 % (28. Februar 2019: 0,47 %)			
550	Honduras Government International Bond, 144A, 6,250 %, due 1/19/2027	599	0,59
Indonesien – 2,99 % (28. Februar 2019: 2,13 %)			
1.750	Indonesia Government International Bond, 144A, 4,125 %, due 1/15/2025	1.874	1,85
270	Indonesia Government International Bond, 144A, 3,850 %, due 7/18/2027	290	0,29
IDR 1.966.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR53, 8,250 %, due 7/15/2021	143	0,14
IDR 10.034.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR61, 7,000 %, due 5/15/2022	717	0,71
		3.024	2,99
Mexiko – 0,27 % (28. Februar 2019: 0,23 %)			
MXN 5.630	Mexican Bonos, Serie M, 6,500 %, due 6/9/2022	278	0,27
Nigeria – 0,51 % (28. Februar 2019: 0,42 %)			
500	Nigeria Government International Bond, 144A, 7,875 %, due 2/16/2032	516	0,51

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Paraguay – 0,66 % (28. Februar 2019: 0,50 %)			
300	Paraguay Government International Bond, 144A, 5,000 %, due 4/15/2026	332	0,33
290	Paraguay Government International Bond, 144A, 5,400 %, due 3/30/2050	341	0,33
		673	0,66
Peru – 0,02 % (28. Februar 2019: 0,01 %)			
12	Peruvian Government International Bond, 7,350 %, due 7/21/2025	16	0,02
Polen – 1,24 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
PLN 4.750	Republik Polen Government Bond, Serie 0727, 2,500 %, due 7/25/2027	1.257	1,24
Russland – 1,04 % (28. Februar 2019: 1,22 %)			
RUB 69.969	Russian Federal Bond - OFZ, Serie 6212, 7,050 %, due 1/19/2028	1.058	1,04
Sri Lanka – 0,57 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
300	Sri Lanka Government International Bond, 6,250 %, due 10/4/2020	305	0,30
270	Sri Lanka Government International Bond, 144A, 6,850 %, due 3/14/2024	275	0,27
		580	0,57
Türkei – 2,73 % (28. Februar 2019: 2,74 %)			
3.160	Turkey Government International Bond, 4,250 %, due 4/14/2026	2.767	2,73
Ukraine – 1,56 % (28. Februar 2019: 1,33 %)			
500	Ukraine Government International Bond, 144A, 7,750 %, due 9/1/2020	515	0,51
1.000	Ukraine Government International Bond, 144A, 7,750 %, due 9/1/2026	1.062	1,05
		1.577	1,56
USA – 2,03 % (28. Februar 2019: 3,97 %)			
800	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, due 5/31/2021	797	0,79
350	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 7/31/2021	352	0,35
900	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 11/30/2021	905	0,89
		2.054	2,03
Uruguay – 0,54 % (28. Februar 2019: 0,52 %)			
UYU 23.350	Uruguay Government International Bond, 8,500 %, due 3/15/2028	552	0,54
Venezuela – 0,12 % (28. Februar 2019: 0,17 %)			
721	Venezuela Government International Bond, 0,000 %, due 10/13/2019 †ε	117	0,12
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 30.813)		26.284	25,95
Schuldscheindarlehen – 5,45 % (28. Februar 2019: 3,12 %)			
191	American Axle & Manufacturing Inc, 4,520 %, due 4/6/2024 *	187	0,18
240	Beta Sub LLC, 6,729 %, due 5/24/2026 *	239	0,24
1.464	Charter Communications Operating LLC, 4,330 %, due 4/30/2025 *	1.469	1,45
273	iHeartCommunications Inc, 6,230 %, due 5/1/2026 *	274	0,27
395	Panda Temple Power LLC, 10,269 %, due 2/7/2023 *	397	0,39
1.748	PetSmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022 *	1.699	1,68
350	Prime Security Services Borrower LLC, 4,984 %, due 5/2/2022 *	350	0,35
682	Reynolds Group Holdings Inc, 4,984 %, due 2/5/2023 *	683	0,67
230	U.S. Renal Care Inc, 7,250 %, due 6/14/2026 *	221	0,22
Loan Notes insgesamt (Anschaffungskosten USD 5.452)		5.519	5,45
Investmentfonds - 6,70 % (28. Februar 2019: 8,04 %)			
17	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM USD ausschüttend (M)	1.700	1,68
EUR 26	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Euro High Yield Fund – LM Klasse Euro (thesaurierend)	5.083	5,02
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 5.968)		6.783	6,70
Stammaktien – 0,80 % (28. Februar 2019: 1,67 %)			
USA – 0,80 % (28. Februar 2019: 1,67 %)			
6	Berry Petroleum Corp	52	0,05
77	Bossier Casino Venture Holdco Inc †∞	16	0,01
–	H&E Equipment Services Inc – New Cotai 'B' †∞	–	–
57	Hercules Offshore Inc †∞	37	0,04
24	Montage Resources Corp	72	0,07
1	MWO Holdings Ltd †∞	81	0,08
25	New Common Shares Panda †	558	0,55
		816	0,80
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 2.932)		816	0,80
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 103.913)		99.146	97,88
Devisenterminkontrakte – 0,11 % (28. Februar 2019: 0,06 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		117	0,11
Futures – 0,25 % (28. Februar 2019: 0,02 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		250	0,25
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		99.513	98,24
Devisenterminkontrakte – (0,32 %) (28. Februar 2019: (0,10 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(328)	(0,32)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(328)	(0,32)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verlust		99.185	97,92
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		2.104	2,08
Nettovermögen insgesamt	USD	101.289	100,00

– Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Registrierung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 31. August 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 36.558.000 oder 36,11 % des Nettovermögens.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

† Illiquide.

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

ε Für das Wertpapier besteht am 31. August 2019 Zahlungsausfall.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual	–	Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen
ARS	–	Argentinischer Peso
BRL	–	Brasilianischer Real
EUR	–	Euro
GBP	–	Britisches Pfund
IDR	–	Indonesische Rupiah
MXN	–	Mexikanischer Peso
PLN	–	Polnischer Zloty
RUB	–	Russischer Rubel
UYU	–	Uruguayischer Peso

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	80,30
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	5,10
Investmentfonds	6,27
Derivate	0,34
Sonstige Vermögenswerte	7,99
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	AUD	–	USD –
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	7	Verkauf	EUR	7	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	15	Verkauf	GBP	12	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	4	Verkauf	USD	4	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	12	Verkauf	USD	8	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	34	Verkauf	USD	24		USD –
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	31	Verkauf	USD	35		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	AUD	12		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	315	Verkauf	AUD	465		2
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.057	Verkauf	EUR	1.850		21
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	GBP	4		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	32	Verkauf	GBP	26		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	66	Verkauf	SGD	92		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	232	Verkauf	SGD	321		1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	4.038	Verkauf	USD	2.926		(15)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	13	Verkauf	USD	9		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	5.887	Verkauf	USD	6.609		(134)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	15.639	Verkauf	USD	10.611		(77)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	26	Verkauf	USD	32		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	966	Verkauf	USD	1.177		(1)
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	574	Verkauf	GBP	457		17
17.10.19	Citi	Kauf	EUR	3.244	Verkauf	USD	3.674		(95)
21.11.19	Citi	Kauf	USD	1.267	Verkauf	EUR	1.129		19
21.11.19	Citi	Kauf	USD	522	Verkauf	GBP	429		(2)
21.11.19	Citi	Kauf	GBP	160	Verkauf	USD	197		(2)
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.582	Verkauf	EUR	2.285		55
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	EUR	154	Verkauf	USD	172		(2)
21.11.19	UBS	Kauf	USD	105	Verkauf	EUR	93		2
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 77)									117
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (122))									(328)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (45))									USD (211)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro FX Currency September 2019	(47)	USD (6.456)	USD 250
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 27)			USD 250
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)			–
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 27)			USD 250

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)			wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 33,04 % (28. Februar 2019: 28,29 %)				
Australien – 1,88 % (28. Februar 2019: 2,03 %)				
CNY	60.000	Commonwealth Bank of Australien, 4,200 %, due 10/26/2020	8.501	1,66
SGD	1.500	National Australia Bank Ltd, 4,150 %, due 5/19/2028 *	1.120	0,22
			9.621	1,88
China – 13,84 % (28. Februar 2019: 14,05 %)				
CNY	42.000	Bank of China Ltd, 6,750 %, Perpetual *	5.895	1,15
HKD	17.000	Bank of China Ltd/Hong Kong, 3,300 %, due 11/20/2020	2.194	0,43
CNY	9.000	Bank of China Ltd/Macau, 3,300 %, due 4/17/2022	1.260	0,25
	3.000	China Aoyuan Group Ltd, 6,350 %, due 1/11/2020	3.008	0,59
	1.300	China Construction Bank Corp., 4,250 %, due 2/27/2029 *	1.369	0,27
	3.150	China Minmetals Corp, 3,750 %, Perpetual *	3.149	0,62
	850	China SCE Group Holdings Ltd, 8,750 %, due 1/15/2021	877	0,17
	6.800	Chinalco Capital Holdings Ltd, 4,250 %, due 4/21/2022	6.814	1,33
	5.000	Coastal Emerald Ltd, 4,300 %, Perpetual *	5.007	0,98
CNY	11.000	Country Garden Holdings Co Ltd, 5,800 %, due 3/12/2021	1.561	0,30
	1.000	Far East Horizon Ltd, 4,332 %, due 7/3/2021 *	1.006	0,20
	5.000	HBIS Group Hong Kong Co Ltd, 4,250 %, due 4/7/2020	5.000	0,98
	5.000	Huaneng Hongkong Capital Ltd, 3,600 %, Perpetual *	4.965	0,97
SGD	7.500	Huarong Finance 2017 Co Ltd, 3,200 %, due 4/27/2021	5.396	1,05
	5.000	Hubei Science & Technology Investment Group Hong Kong Ltd, 4,375 %, due 3/5/2021	5.030	0,98
	1.100	Longfor Group Holdings Ltd, 4,500 %, due 1/16/2028	1.145	0,22
CNY	23.000	Shimao Property Holdings Ltd, 5,750 %, due 3/15/2021	3.288	0,64
	1.000	Spic 2018 Usd Senior Perpetual Bond Co Ltd, 5,800 %, Perpetual *	1.057	0,21
	1.700	Trade Horizon Global Ltd, 4,841 %, due 8/2/2021 *	1.709	0,33
	4.800	Tsinghua Unic Ltd, 4,750 %, due 1/31/2021	4.644	0,91
	3.100	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 5,350 %, due 3/11/2024	3.387	0,66
	3.000	Yuzhou Properties Co Ltd, 7,900 %, due 5/11/2021	3.052	0,60
			70.813	13,84
Frankreich – 1,43 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
SGD	10.000	Credit Agricole SA, 3,800 %, due 4/30/2031 *	7.311	1,43
Deutschland – 0,17 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
CNY	6.000	Daimler International Finance BV, 3,780 %, due 3/22/2022	847	0,17
Hongkong – 3,07 % (28. Februar 2019: 2,88 %)				
	3.700	Bank of East Asia Ltd/The, 4,000 %, due 11/3/2026 *	3.752	0,73
	2.000	Bank of East Asia Ltd/The, 5,500 %, Perpetual *	2.009	0,39
	1.200	Dah Sing Bank Ltd, 4,250 %, due 11/30/2026 *	1.225	0,24
	250	Dah Sing Bank Ltd, 5,000 %, due 1/15/2029 *	267	0,05
	8.600	Radiant Access Ltd, 4,600 %, Perpetual	8.475	1,66
			15.728	3,07
Indonesien – 5,47 % (28. Februar 2019: 4,35 %)				
	3.800	Bank Mandiri Persero Tbk PT, 3,750 %, due 4/11/2024	3.931	0,77
IDR	41.000.000	Jasa Marga Persero Tbk PT, 7,500 %, due 12/11/2020	2.828	0,55
	3.000	Minejesa Capital BV, 5,625 %, due 8/10/2037	3.342	0,65
	1.000	Pelabuhan Indonesia II PT, 4,250 %, due 5/5/2025	1.065	0,21
	9.150	Pelabuhan Indonesia II PT, 5,375 %, due 5/5/2045	10.409	2,03
	4.000	Perusahaan Listrik Negara PT, 4,125 %, due 5/15/2027	4.284	0,84
	1.750	Saka Energi Indonesia PT, 4,450 %, due 5/5/2024	1.765	0,35
IDR	5.000.000	Sarana Multigriya Finansial Persero PT, Serie OB, 6,850 %, due 2/20/2021	349	0,07
			27.973	5,47
Katar – 1,45 % (28. Februar 2019: 1,56 %)				
CNY	35.000	QNB Finance Ltd, 5,100 %, due 5/14/2021	5.029	0,98
CNY	16.700	QNB Finance Ltd, 4,350 %, due 1/29/2022	2.379	0,47
			7.408	1,45
Singapur – 1,80 % (28. Februar 2019: 1,90 %)				
SGD	5.000	DBS Group Holdings Ltd, 2,780 %, due 1/11/2021	3.625	0,71
SGD	2.750	Mapletree Commercial Trust Treasury Co Pte Ltd, 3,110 %, due 8/24/2026	2.006	0,39
HKD	7.000	Mapletree North Asia Commercial Treasury Co HKSAR Ltd, 2,800 %, due 2/11/2020	891	0,18
SGD	2.000	Sing Tel Group Treasury Pte Ltd, 2,580 %, due 9/24/2020	1.447	0,28
	1.000	United Overseas Bank Ltd, 3,750 %, due 4/15/2029 *	1.042	0,20
	200	United Overseas Bank Ltd, 3,875 %, Perpetual *	201	0,04
			9.212	1,80
Supranational – 3,93 % (28. Februar 2019: 1,10 %)				
IDR	200.000.000	European Investment Bank, 7,400 %, due 1/24/2022	14.368	2,81
IDR	77.000.000	International Finance Corp., 8,000 %, due 10/9/2023	5.721	1,12
			20.089	3,93
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 168.691)			169.002	33,04
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 58,88 % (28. Februar 2019: 63,63 %)				
China – 5,29 % (28. Februar 2019: 6,07 %)				
CNY	10.000	China Development Bank, Serie 1803, 4,620 %, due 3/9/2021	1.435	0,28
HKD	7.500	China Development Bank Corp./Hongkong, 2,819 %, due 1/24/2024 *	950	0,19
CNY	68.000	China Government Bond, 3,380 %, due 11/21/2024	9.707	1,90
CNY	96.500	China Government Bond, 3,600 %, due 5/21/2030	14.244	2,78
CNY	5.000	Export-Import Bank of China/The, 4,400 %, due 5/14/2024	733	0,14
			27.069	5,29
Indien – 14,11 % (28. Februar 2019: 13,49 %)				
INR	500.000	India Government Bond, 8,150 %, due 6/11/2022	7.391	1,44
INR	980.000	India Government Bond, 8,150 %, due 11/24/2026	14.792	2,89
INR	980.000	India Government Bond, Serie SPB, 8,240 %, due 2/15/2027	14.928	2,92
INR	1.250.000	India Government Bond, 7,170 %, due 1/8/2028	18.110	3,54
INR	1.000.000	India Government Bond, 7,610 %, due 5/9/2030	14.795	2,89
INR	160.000	India Government Bond, 6,570 %, due 12/5/2033	2.184	0,43
			72.200	14,11
Indonesien – 9,56 % (28. Februar 2019: 12,83 %)				
IDR	51.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR77, 8,125 %, due 5/15/2024	3.796	0,74
IDR	171.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR56, 8,375 %, due 9/15/2026	12.808	2,50
IDR	108.875.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR59, 7,000 %, due 5/15/2027	7.564	1,48
IDR	20.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR47, 10,000 %, due 2/15/2028	1.649	0,32
IDR	27.500.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR64, 6,125 %, due 5/15/2028	1.791	0,35
IDR	114.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR54, 9,500 %, due 7/15/2031	9.178	1,80
IDR	25.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR58, 8,250 %, due 6/15/2032	1.840	0,36
IDR	20.000.000	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Serie Ob, 8,400 %, due 2/23/2020	1.418	0,28
IDR	20.000.000	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Series Ob, 9,500 %, due 3/13/2020	1.427	0,28
IDR	5.000.000	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Series Ob, 8,350 %, due 8/25/2021	351	0,07
IDR	100.000.000	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Series Ob, 8,250 %, due 8/15/2024	7.074	1,38
			48.896	9,56
Malaysia – 6,01 % (28. Februar 2019: 4,99 %)				
MYR	22.380	Malaysia Government Bond, Serie 0115, 3,955 %, due 9/15/2025	5.518	1,08
MYR	1.200	Malaysia Government Bond, Serie 0308, 5,248 %, due 9/15/2028	327	0,06
MYR	78.000	Malaysia Government Bond, Serie 0411, 4,232 %, due 6/30/2031	19.869	3,89
MYR	20.360	Malaysia Government Bond, Serie 0419, 3,828 %, due 7/5/2034	5.030	0,98
			30.744	6,01
Philippinen – 7,27 % (28. Februar 2019: 6,69 %)				
CNY	20.000	Philippine Government International Bond, 5,000 %, due 3/23/2021	2.868	0,56
PHP	276.000	Philippine Government International Bond, 3,900 %, due 11/26/2022	5.277	1,03
PHP	1.256.000	Philippine Government International Bond, 6,250 %, due 1/14/2036	29.037	5,68
			37.182	7,27

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Singapur – 3,49 % (28. Februar 2019: 6,20 %)			
SGD 1.500	Singapore Government Bond, 2,750 %, due 4/1/2042	1.236	0,24
SGD 20.000	Singapore Government Bond, 2,750 %, due 3/1/2046	16.611	3,25
		17.847	3,49
Südkorea – 3,30 % (28. Februar 2019: 3,49 %)			
IDR 80.000.000	Export-Import Bank of Korea, 8,400 %, due 11/30/2021	5.754	1,12
1.300	Industrial Bank of Korea, 3,900 %, Perpetual *	1.308	0,26
CNY 69.000	Korea Development Bank/ The, 4,650 %, due 3/12/2021	9.846	1,92
		16.908	3,30
Sri Lanka – 1,09 % (28. Februar 2019: 1,09 %)			
2.000	Sri Lanka Government International Bond, 5,875 %, due 7/25/2022	2.005	0,39
3.800	Sri Lanka Government International Bond, 6,200 %, due 5/11/2027	3.568	0,70
		5.573	1,09
Thailand – 6,22 % (28. Februar 2019: 5,66 %)			
THB 525.000	Thailand Government Bond, 3,850 %, due 12/12/2025	19.688	3,85
THB 170.000	Thailand Government Bond, 2,125 %, due 12/17/2026	5.834	1,14
THB 150.000	Thailand Government Bond, 3,300 %, due 6/17/2038	6.288	1,23
		31.810	6,22
USA – 2,54 % (28. Februar 2019: 1,40 %)			
13.000	United States Treasury Bill, zero coupon, due 9/17/2019	12.990	2,54
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 308.091)		301.219	58,88

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Total Return Swaps – 1,49 % (28. Februar 2019: 1,49 %)			
Indonesien – 1,49 % (28. Februar 2019: 1,49 %)			
IDR 10.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR46, 9,500 %, due 7/15/2023 ∞	770	0,15
IDR 45.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR52, 10,500 %, due 8/15/2030 ∞	3.855	0,76
IDR 37.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR54, 9,500 %, due 7/15/2031 ∞	2.979	0,58
		7.604	1,49
Total Return Swaps insgesamt (Anschaffungskosten USD 10.359)		7.604	1,49
Investmentfonds - 4,47 % (28. Februar 2019: 4,67 %)			
1.000	Western Asset China Bond Fund – Klasse M	12.160	2,38
SGD 4.962	Legg Mason Western Asset Asiatische Anleihe - Klasse A (SGD) Thesaurierend ∞	6.053	1,18
4.666	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	4.666	0,91
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 19.653)		22.879	4,47
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 506.794)		500.704	97,88
Devisenterminkontrakte – 0,13 % (28. Februar 2019: 0,07 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		658	0,13
Futures – 0,43 % (28. Februar 2019: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		2.182	0,43
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		503.544	98,44

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Devisenterminkontrakte – (0,25 %) (28. Februar 2019: (0,13 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(1.281)	(0,25)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(1.281)	(0,25)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verlust		502.263	98,19
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		9.304	1,81
Nettovermögen insgesamt		USD 511.567	100,00

– Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

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

ABKÜRZUNGEN:

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

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,68
Investmentfonds	4,44
Derivate	0,55
Sonstige Vermögenswerte	2,33
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	183	Verkauf	CNH	1.315	USD –
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	13	Verkauf	USD	14	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	2	Verkauf	USD	2	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	111	Verkauf	AUD	165	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	349	Verkauf	CNH	2.493	1
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	EUR	5	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	SGD	1	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	USD	–	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	HKD	1.654	Verkauf	USD	211	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	HKD	2	Verkauf	USD	–	–
04.09.19	JP Morgan	Kauf	USD	14.035	Verkauf	HKD	110.000	5
05.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	39	Verkauf	AUD	58	–
05.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	139	Verkauf	CNH	990	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1.264	Verkauf	AUD	1.866	8
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	64	Verkauf	CNH	457	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	261	Verkauf	CNH	1.839	5
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	12	Verkauf	EUR	11	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	21	Verkauf	SGD	28	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	SGD	1	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	26	Verkauf	USD	32	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CNH	2.004	Verkauf	USD	279	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	7	Verkauf	USD	6	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)				Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	4.242	Verkauf	USD	3.072		USD (16)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	40.278	Verkauf	USD	27.332		(197)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	282	Verkauf	USD	190		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CHF	331	Verkauf	USD	340		(6)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CNH	115.462	Verkauf	USD	16.325		(204)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	5.254	Verkauf	USD	5.902		(123)
30.09.19	Citi	Kauf	USD	14.663	Verkauf	AUD	21.000		508
30.09.19	Citi	Kauf	KRW	52.250.000	Verkauf	USD	43.105		91
30.09.19	Citi	Kauf	AUD	21.000	Verkauf	USD	14.383		(228)
30.09.19	State Street Bank & Trust Co	Kauf	KRW	23.250.000	Verkauf	USD	19.181		40
25.10.19	State Street Bank & Trust Co	Kauf	SGD	36.510	Verkauf	USD	26.833		(507)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 346)									658
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (625))									(1.281)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (279))									USD (623)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
Korea 10Yr Bnd Fu Sep19	805	USD 89.456	USD 2.182
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 73)			USD 2.182
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (22))			–
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 51)			USD 2.182

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 73,13 % (28. Februar 2019: 80,24 %)			
Australien – 1,51 % (28. Februar 2019: 2,36 %)			
GBP 170	BHP Billiton Finance Ltd, Serie 11, 3,250 %, due 9/25/2024	230	0,11
300	BHP Billiton Finance USA Ltd, 2,875 %, due 2/24/2022	307	0,15
GBP 305	Macquarie Bank Ltd, 3,500 %, due 12/18/2020	383	0,19
EUR 720	Optus Finance Pty Ltd, 1,000 %, due 6/20/2029	846	0,41
EUR 287	Telstra Corp Ltd, 3,750 %, due 5/16/2022	350	0,17
GBP 550	Toyota Finance Australia Ltd, 1,625 %, due 7/11/2022	684	0,34
GBP 230	Westpac Banking Corp, 2,625 %, due 12/14/2022	295	0,14
		3.095	1,51
Belgien – 2,16 % (28. Februar 2019: 2,68 %)			
450	Anheuser-Busch InBev NV Worldwide Inc, 2,500 %, due 7/15/2022	457	0,22
150	Anheuser-Busch InBev NV Worldwide Inc, 3,500 %, due 1/12/2024	159	0,08
1.920	Anheuser-Busch InBev NV Worldwide Inc, 4,000 %, due 4/13/2028	2.129	1,04
EUR 650	Euroclear Bank SA, 0,500 %, due 7/10/2023	736	0,36
EUR 400	Euroclear Investments SA, 1,125 %, due 12/7/2026	479	0,24
EUR 400	KBC Group NV, 0,750 %, due 3/1/2022	451	0,22
		4.411	2,16
Kanada – 3,44 % (28. Februar 2019: 2,10 %)			
500	Bank of Montreal, Serie D, 3,100 %, due 4/13/2021	509	0,25
EUR 2.200	Bank of Nova Scotia/The, 0,500 %, due 4/30/2024	2.481	1,21
290	Royal Bank of Canada, 2,150 %, due 10/26/2020	291	0,14
1.300	Royal Bank of Canada, 3,700 %, due 10/5/2023	1.383	0,68
EUR 2.110	Toronto-Dominion Bank/The, 0,375 %, due 4/25/2024	2.368	1,16
		7.032	3,44
Dänemark – 1,15 % (28. Februar 2019: 0,61 %)			
EUR 550	Danske Bank A/S, 0,875 %, due 5/22/2023	619	0,30
1.580	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, due 1/12/2024	1.743	0,85
		2.362	1,15
Finnland – 0,53 % (28. Februar 2019: 1,08 %)			
EUR 950	Nordea Bank Abp, 0,875 %, due 6/26/2023	1.083	0,53
Frankreich – 6,19 % (28. Februar 2019: 8,90 %)			
EUR 350	Airbus Finance BV, 2,375 %, due 4/2/2024	430	0,21
EUR 800	APRR SA, 1,500 %, due 1/25/2030	996	0,49
670	BNP Paribas SA, 3,250 %, due 3/3/2023	698	0,34
230	BNP Paribas SA, 4,705 %, due 1/10/2025 *	249	0,12
EUR 1.100	BNP Paribas SA, 1,375 %, due 5/28/2029	1.319	0,64
EUR 1.000	BPCE SA, 1,000 %, due 4/1/2025	1.149	0,56
EUR 300	Credit Agricole SA/London, 1,250 %, due 4/14/2026	361	0,18
EUR 300	Credit Agricole SA/London, 1,750 %, due 3/5/2029	372	0,18
EUR 200	Electricite de France SA, 2,750 %, due 3/10/2023	243	0,12
EUR 400	Engie SA, 1,000 %, due 3/13/2026	471	0,23
EUR 400	Engie SA, 2,375 %, due 5/19/2026	512	0,25
EUR 600	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 1,000 %, due 10/19/2026	710	0,35
EUR 300	Sanofi, Serie 5FXD, 0,500 %, due 3/21/2023	339	0,17
1.040	Sanofi, 3,625 %, due 6/19/2028	1.169	0,57
EUR 400	Thales SA, 0,875 %, due 4/19/2024	462	0,22
EUR 1.100	Total Capital International SA, 1,023 %, due 3/4/2027	1.312	0,64
EUR 1.600	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1,125 %, due 9/15/2025	1.878	0,92
		12.670	6,19
Deutschland – 4,02 % (28. Februar 2019: 5,95 %)			
EUR 700	Allianz Finance II BV, 1,500 %, due 1/15/2030	885	0,43
GBP 200	BASF SE, 1,375 %, due 6/21/2022	247	0,12
EUR 300	BASF SE, 0,875 %, due 11/15/2027	356	0,17
GBP 450	BMW US Capital LLC, 2,000 %, due 11/20/2019	550	0,27
770	Daimler Finance North America LLC, 2,850 %, due 1/6/2022	778	0,38
EUR 500	Deutsche Boerse AG, 1,125 %, due 3/26/2028	611	0,30
EUR 500	SAP SE, 0,250 %, due 3/10/2022	558	0,27
EUR 300	SAP SE, 1,750 %, due 2/22/2027	377	0,18
EUR 700	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1,000 %, due 9/6/2027	840	0,41
EUR 200	Vier Gas Transport GmbH, 1,500 %, due 9/25/2028	248	0,12
EUR 200	Volkswagen Bank GmbH, 0,625 %, due 9/8/2021	223	0,11
EUR 360	Volkswagen Bank GmbH, 0,750 %, due 6/15/2023	404	0,20
EUR 920	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, due 10/1/2024	1.060	0,52
GBP 900	Volkswagen Financial Services NV, 1,625 %, due 11/30/2022	1.097	0,54
		8.234	4,02
Hongkong – 0,23 % (28. Februar 2019: 0,45 %)			
EUR 400	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 1,250 %, due 4/13/2025	465	0,23
Japan – 1,71 % (28. Februar 2019: 3,67 %)			
1.450	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,218 %, due 3/7/2022	1.487	0,73
EUR 120	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 0,680 %, due 1/26/2023	136	0,06
EUR 750	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 0,980 %, due 10/9/2023	859	0,42
EUR 550	Mizuho Financial Group Inc, 1,598 %, due 4/10/2028	692	0,34
EUR 270	Sumitomo Mitsui Banking Corp, 2,750 %, due 7/24/2023	331	0,16
		3.505	1,71
Luxemburg – 0,22 % (28. Februar 2019: 0,43 %)			
EUR 375	Prologis International Funding II SA, 1,750 %, due 3/15/2028	457	0,22
Niederlande – 4,12 % (28. Februar 2019: 3,57 %)			
EUR 220	ABN AMRO Bank NV, 1,000 %, due 4/16/2025	259	0,13
150	Cooperatieve Rabobank UA, 3,875 %, due 2/8/2022	157	0,08
EUR 200	Cooperatieve Rabobank UA, 0,750 %, due 8/29/2023	227	0,11
250	Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,125 %, due 4/26/2021	254	0,12
270	Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375 %, due 5/21/2025	291	0,14
EUR 3.080	Enexis Holding NV, 0,750 %, due 7/2/2031	3.567	1,74
EUR 400	Euronext NV, 1,000 %, due 4/18/2025	465	0,23
EUR 400	ING Groep NV, 0,750 %, due 3/9/2022	450	0,22
EUR 200	ING Groep NV, 1,000 %, due 9/20/2023	229	0,11
EUR 300	ING Groep NV, 2,125 %, due 1/10/2026	372	0,18
1.780	Shell International Finance BV, 3,250 %, due 5/11/2025	1.894	0,93
EUR 220	TenneT Holding BV, 1,375 %, due 6/5/2028	269	0,13
		8.434	4,12
Norwegen – 0,72 % (28. Februar 2019: 1,45 %)			
EUR 540	Equinor ASA, 1,250 %, due 2/17/2027	653	0,32
EUR 390	Sparebank 1 Oestlandet, 0,875 %, due 3/13/2023	444	0,22
EUR 330	Sparebanken Vest, 0,500 %, due 11/29/2022	371	0,18
		1.468	0,72
Singapur – 0,40 % (28. Februar 2019: 0,79 %)			
810	Temasek Financial I Ltd, 2,375 %, due 1/23/2023	824	0,40
Spanien – 0,72 % (28. Februar 2019: 1,46 %)			
800	Banco Santander SA, 3,848 %, due 4/12/2023	837	0,41
GBP 500	Banco Santander SA, 2,750 %, due 9/12/2023	637	0,31
		1.474	0,72
Schweden – 1,48 % (28. Februar 2019: 1,69 %)			
EUR 1.240	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,050 %, due 7/1/2024	1.379	0,67
540	Svenska Handelsbanken AB, 1,875 %, due 9/7/2021	538	0,26
GBP 500	Svenska Handelsbanken AB, 1,625 %, due 6/18/2022	619	0,30
EUR 450	Swedbank AB, 0,300 %, due 9/6/2022	502	0,25
		3.038	1,48
Schweiz – 2,43 % (28. Februar 2019: 3,58 %)			
450	ABB Finance USA Inc, 2,800 %, due 4/3/2020	452	0,22
EUR 800	Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, due 12/15/2028	993	0,49
500	Credit Suisse AG/New York NY, 3,625 %, due 9/9/2024	533	0,26
GBP 1.050	Credit Suisse Group AG, 2,125 %, due 9/12/2025 *	1.297	0,63
GBP 320	Nestle Finance International Ltd, 2,250 %, due 11/30/2023	416	0,20
EUR 180	Novartis Finance SA, 0,500 %, due 8/14/2023	205	0,10
EUR 380	Richemont International Holding SA, 1,000 %, due 3/26/2026	448	0,22
400	UBS Group Funding Switzerland AG, 3,000 %, due 4/15/2021	405	0,20
EUR 200	UBS Group Funding Switzerland AG, 1,750 %, due 11/16/2022	233	0,11
		4.982	2,43
Großbritannien – 8,13 % (28. Februar 2019: 11,12 %)			
EUR 800	Aviva Plc, 1,875 %, due 11/13/2027	988	0,48

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Großbritannien – (Fortsetzung)			
EUR 250	Barclays Plc, 1,875 %, due 3/23/2021	283	0,14
EUR 350	BP Capital Markets Plc, 0,900 %, due 7/3/2024	404	0,20
2.055	BP Capital Markets Plc, 3,506 %, due 3/17/2025	2.192	1,07
GBP 180	Close Brothers Finance Plc, 3,875 %, due 6/27/2021	230	0,11
GBP 150	Close Brothers Group Plc, 2,750 %, due 4/26/2023	190	0,09
410	Diageo Capital Plc, 2,625 %, due 4/29/2023	420	0,20
EUR 1.000	Diageo Finance Plc, 0,125 %, due 10/12/2023	1.117	0,55
EUR 220	Diageo Finance Plc, 1,500 %, due 10/22/2027	270	0,13
190	GlaxoSmithKline Capital Plc, 2,850 %, due 5/8/2022	195	0,10
EUR 270	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,250 %, due 5/21/2026	323	0,16
EUR 550	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,000 %, due 9/12/2026	649	0,32
EUR 520	HSBC Holdings Plc, 0,875 %, due 9/6/2024	595	0,29
1.660	HSBC Holdings Plc, 3,803 %, due 3/11/2025 *	1.735	0,85
GBP 300	HSBC Holdings Plc, 3,000 %, due 7/22/2028 *	389	0,19
EUR 280	Leeds Building Society, 2,625 %, due 4/1/2021	322	0,16
GBP 270	Lloyds Bank Plc, 2,500 %, due 6/1/2022	342	0,17
EUR 200	London Stock Exchange Group Plc, 0,875 %, due 9/19/2024	229	0,11
EUR 690	London Stock Exchange Group Plc, 1,750 %, due 12/6/2027	836	0,41
650	Nationwide Building Society, 144A, 3,622 %, due 4/26/2023 *	665	0,32
680	Reckitt Benckiser Treasury Services Plc, 2,375 %, due 6/24/2022	685	0,33
GBP 200	Rolls-Royce Plc, 3,375 %, due 6/18/2026	270	0,13
EUR 240	Rolls-Royce Plc, 1,625 %, due 5/9/2028	289	0,14
GBP 400	Santander UK Plc, 1,625 %, due 5/10/2021	491	0,24
850	Unilever Capital Corp, 3,250 %, due 3/7/2024	898	0,44
EUR 550	Unilever NV, 1,125 %, due 2/12/2027	663	0,32
EUR 810	Wellcome Trust Ltd/The, 1,125 %, due 1/21/2027	973	0,48
		16.643	8,13
USA – 33,97 % (28. Februar 2019: 28,35 %)			
370	AbbVie Inc, 3,600 %, due 5/14/2025	386	0,19
350	Altria Group Inc, 2,850 %, due 8/9/2022	357	0,18
1.980	Amazon.com Inc, 3,800 %, due 12/5/2024	2.163	1,06
530	American Express Co, 2,650 %, due 12/2/2022	541	0,26
340	Apple Inc, 3,200 %, due 5/13/2025	363	0,18
200	AT&T Inc, 3,875 %, due 8/15/2021	207	0,10
1.690	AT&T Inc, 3,400 %, due 5/15/2025	1.772	0,87
200	Bank of America Corp, 3,300 %, due 1/11/2023	208	0,10
646	Bank of America Corp, 3,004 %, due 12/20/2023 *	663	0,32
1.670	Bank of America Corp, 3,550 %, due 3/5/2024 *	1.746	0,85
EUR 500	Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, due 3/16/2027	595	0,29
EUR 530	BlackRock Inc, 1,250 %, due 5/6/2025	631	0,31
EUR 550	Blackstone Holdings Finance Co LLC, 1,000 %, due 10/5/2026	638	0,31
1.690	Boeing Co/The, 3,100 %, due 5/1/2026	1.787	0,87
2.000	Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 2,900 %, due 7/26/2024	2.074	1,01
200	Caterpillar Financial Services Corp, 1,931 %, due 10/1/2021	200	0,10
800	Chevron Corp, 2,355 %, due 12/5/2022	815	0,40
310	Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, due 5/3/2026	333	0,16
EUR 1.300	Chubb INA Holdings Inc, 0,875 %, due 6/15/2027	1.501	0,73
EUR 800	Chubb INA Holdings Inc, 1,550 %, due 3/15/2028	971	0,48
150	Citigroup Inc, 3,236 %, due 4/25/2022 *	152	0,07
GBP 230	Citigroup Inc, 2,750 %, due 1/24/2024	295	0,15
2.060	Citigroup Inc, 3,300 %, due 4/27/2025	2.180	1,07
250	Coca-Cola Co/The, 3,150 %, due 11/15/2020	254	0,12
EUR 500	Coca-Cola Co/The, 0,125 %, due 9/22/2022	557	0,27
390	Colgate-Palmolive Co, 2,450 %, due 11/15/2021	397	0,19
EUR 1.300	Colgate-Palmolive Co, 0,500 %, due 3/6/2026	1.497	0,73
1.000	Comcast Corp, 3,700 %, due 4/15/2024	1.071	0,52
390	Comcast Corp, 3,150 %, due 3/1/2026	412	0,20
780	Exxon Mobil Corp, 3,043 %, due 3/1/2026	829	0,41
EUR 290	General Electric Co, 0,875 %, due 5/17/2025	314	0,15
150	Gilead Sciences Inc, 2,550 %, due 9/1/2020	151	0,07
1.830	Gilead Sciences Inc, 3,650 %, due 3/1/2026	1.969	0,96
520	Goldman Sachs Group Inc/The, Serie D, 6,000 %, due 6/15/2020	535	0,26
2.100	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625 %, due 1/22/2023	2.198	1,07
EUR 1.750	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,125 %, due 8/19/2024	1.926	0,94
2.060	Honeywell International Inc, 2,500 %, due 11/1/2026	2.121	1,04
EUR 1.020	Illinois Tool Works Inc, 0,250 %, due 12/5/2024	1.145	0,56
EUR 350	Johnson & Johnson, 0,250 %, due 1/20/2022	391	0,19
110	Johnson & Johnson, 3,375 %, due 12/5/2023	117	0,06
310	JPMorgan Chase & Co, 3,200 %, due 1/25/2023	322	0,16
1.640	JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, due 12/5/2024 *	1.764	0,86
EUR 320	JPMorgan Chase & Co, 1,500 %, due 10/29/2026	389	0,19
910	Kimberly-Clark Corp, 3,950 %, due 11/1/2028	1.043	0,51
250	Komatsu Finance America Inc, 2,118 %, due 9/11/2020	249	0,12
1.150	Mars Inc, 2,700 %, due 4/1/2025	1.190	0,58
280	Mastercard Inc, 3,375 %, due 4/1/2024	299	0,15
EUR 500	Medtronic Global Holdings SCA, Serie 0000, 0,375 %, due 3/7/2023	559	0,27
EUR 1.400	Medtronic Global Holdings SCA, 0,250 %, due 7/2/2025	1.566	0,77
570	Microsoft Corp, 2,700 %, due 2/12/2025	596	0,29
120	Morgan Stanley, 2,500 %, due 4/21/2021	121	0,06
EUR 330	Morgan Stanley, 1,375 %, due 10/27/2026	392	0,19
2.080	Nuveen LLC, 4,000 %, due 11/1/2028	2.360	1,15
1.110	Occidental Petroleum Corp, 2,700 %, due 2/15/2023	1.113	0,54
560	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, due 6/15/2025	576	0,28
220	Oracle Corp, 2,500 %, due 10/15/2022	224	0,11
50	PepsiCo Inc, 2,750 %, due 3/5/2022	51	0,03
GBP 300	PepsiCo Inc, 2,500 %, due 11/1/2022	385	0,19
EUR 310	PepsiCo Inc, 0,750 %, due 3/18/2027	362	0,18
100	Philip Morris International Inc, 1,875 %, due 2/25/2021	100	0,05
340	Philip Morris International Inc, 2,900 %, due 11/15/2021	346	0,17
EUR 1.250	Procter & Gamble Co/The, 0,625 %, due 10/30/2024	1.438	0,70
EUR 350	Prologis Euro Finance LLC, 1,875 %, due 1/5/2029	438	0,21
570	salesforce.com Inc, 3,250 %, due 4/11/2023	596	0,29
430	Schlumberger Holdings Corp, 4,000 %, due 12/21/2025	462	0,23
1.150	Texas Instruments Inc, 2,900 %, due 11/3/2027	1.217	0,60
538	Toyota Motor Credit Corp, 3,400 %, due 9/15/2021	554	0,27
EUR 2.000	United Parcel Service Inc, 1,625 %, due 11/15/2025	2.424	1,18
2.150	UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, due 7/15/2025	2.341	1,14
2.243	Verizon Communications Inc, 4,329 %, due 9/21/2028	2.577	1,26
150	Visa Inc, 2,800 %, due 12/14/2022	155	0,08
540	Visa Inc, 3,150 %, due 12/14/2025	579	0,28
1.900	Walmart Inc, 3,250 %, due 7/8/2029	2.087	1,02
1.660	Waste Management Inc, 3,500 %, due 5/15/2024	1.762	0,86
230	Wells Fargo & Co, 3,500 %, due 3/8/2022	238	0,12
700	Wells Fargo & Co, 3,069 %, due 1/24/2023	716	0,35
1.430	Wells Fargo & Co, 3,196 %, due 6/17/2027 *	1.491	0,73
		69.544	33,97
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 147.479)		149.721	73,13
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 16,90 % (28. Februar 2019: 15,43 %)			
Südkorea – 0,92 % (28. Februar 2019: 1,14 %)			
EUR 1.000	Export-Import Bank of Korea, 0,625 %, due 7/11/2023	1.139	0,56
EUR 660	Korea Development Bank/The, 0,000 %, due 7/10/2024	738	0,36
		1.877	0,92
USA – 15,98 % (28. Februar 2019: 13,84 %)			
14.180	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 3/31/2022	14.291	6,98
5.380	United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, due 3/31/2023	5.582	2,73
11.520	United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 3/31/2024	11.881	5,80
910	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 11/15/2027	964	0,47
		32.718	15,98
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 33.852)		34.595	16,90

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Investmentfonds - 8,24 % (28. Februar 2019: 4,26 %)			
16.866	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	16.866	8,24
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 16.866)		16.866	8,24
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 198.197)		201.182	98,27
Devisenterminkontrakte – 0,62 % (28. Februar 2019: 2,25 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.277	0,62
Futures – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,02 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1	–
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		202.460	98,89

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Credit Default Swaps – (0,20 %) (28. Februar 2019: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(400)	(0,20)
Devisenterminkontrakte – (0,11 %) (28. Februar 2019: 0,17 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(230)	(0,11)
Futures – (0,62 %) (28. Februar 2019: (0,50 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.280)	(0,62)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	(1.910)	(0,93)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten	200.550	97,96
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	4.171	2,04
Gesamtnettovermögen	USD 204.721	100,00

– Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Registrierung 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 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 4.482.000 und machten 2,18 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

EUR – Euro

GBP – Britisches Pfund

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	88,71
Investmentfonds	8,12
Derivate	0,62
Sonstige Vermögenswerte	2,55
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kauf/Verkauf Schutz	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)		wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 %	Kauf	20.6.2024	14.680	USD	(400)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)					USD	–
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)						(400)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)					USD	(400)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	123	Verkauf	USD	151	USD	(1)
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	369	Verkauf	GBP	303		–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	72	Verkauf	USD	88		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	EUR	3		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	693	Verkauf	GBP	566		4
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	766	Verkauf	GBP	630		(2)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	146.747	Verkauf	USD	178.735		(92)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	4.962	Verkauf	USD	6.017		24
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.507	Verkauf	USD	3.934		(76)
21.11.19	Citi	Kauf	USD	12.735	Verkauf	EUR	11.345		190
21.11.19	Citi	Kauf	USD	1.101	Verkauf	GBP	900		3
21.11.19	Citi	Kauf	USD	351	Verkauf	GBP	289		(1)
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	4.923	Verkauf	EUR	4.368		92
21.11.19	HSBC	Kauf	USD	12.430	Verkauf	EUR	11.013		251
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	17.718	Verkauf	EUR	15.745		306
21.11.19	Royal Bank of Canada	Kauf	USD	857	Verkauf	GBP	706		(6)
21.11.19	UBS	Kauf	USD	22.321	Verkauf	EUR	19.816		407
21.11.19	UBS	Kauf	USD	6.941	Verkauf	GBP	5.729		(52)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2.256)									1.277
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (166))									(230)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2.090)								USD	1.047

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht Realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl September 2019	(157)	USD (23.507)	USD (423)
Euro-Bund December 2019	(53)	(10.268)	–
Euro-Bund September 2019	(93)	(18.306)	(771)
Long Gilt December 2019	(12)	(1.961)	1
U.S. 10 Year Note (CBT) December 2019	(99)	(13.040)	(53)
U.S. 5 Year Note (CBT) December 2019	(111)	(13.317)	(33)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 22)			USD 1
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (504))			(1.280)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (482))			USD (1.279)

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Asset-Backed Securities - 0,08 % (28. Februar 2019: 0,10 %)			
221	Nelnet Student Loan Trust 2008-3, Serie 2008 3, Klasse A4, 3,782 %, due 11/25/2024 *	221	0,08
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 65)		221	0,08
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 14,44 % (28. Februar 2019 12,15 %)			
1.100	Fannie Mae oder Freddie Mac, 15 year, TBA, 4,000 % ± 3,500 %)	1.140	0,44
500	Fannie Mae oder Freddie Mac, 15 year, TBA, 4,000 % ± 2,500 %)	507	0,19
1.000	Fannie Mae oder Freddie Mac, 15 year, TBA, 4,000 % ± 3,000 %)	1.026	0,39
1.100	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000 % ± 4,000 %)	1.142	0,44
800	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000 % ± 4,500 %)	842	0,32
200	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000 % ± 5,000 %)	214	0,08
900	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000 % ± 3,000 %)	918	0,35
16	Fannie Mae Pool '255984', 4,500 %, due 11/1/2025	17	0,01
25	Fannie Mae Pool '975097', 5,000 %, due 6/1/2038	28	0,01
153	Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, due 1/1/2043	160	0,06
24	Fannie Mae Pool 'AL3572', 5,000 %, due 7/1/2041	27	0,01
163	Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, due 5/1/2045	178	0,07
52	Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500 %, due 1/1/2045	58	0,02
682	Fannie Mae Pool 'AS8359', 3,000 %, due 11/1/2046	701	0,27
228	Fannie Mae Pool 'AS9453', 4,000 %, due 4/1/2047	242	0,09
870	Fannie Mae Pool 'AX0756', 3,500 %, due 7/1/2044	916	0,35
437	Fannie Mae Pool 'BE3708', 4,500 %, due 6/1/2047	462	0,18
1.481	Fannie Mae Pool 'BH4101', 3,500 %, due 10/1/2047	1.533	0,59
1.437	Fannie Mae Pool 'BH7558', 4,500 %, due 9/7/2034	1.533	0,59
347	Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, due 12/1/2037	357	0,14
92	Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, due 12/1/2046	96	0,04
100	Fannie Mae Pool 'BO0968', 4,000 %, due 6/1/2049	104	0,04
100	Fannie Mae Pool 'BO3815', 3,000 %, due 8/1/2049	102	0,04
83	Fannie Mae Pool 'CA2652', 5,000 %, due 11/1/2048	89	0,03
200	Fannie Mae Pool 'CA4017', 3,000 %, due 8/1/2049	204	0,08
100	Fannie Mae Pool 'CA4078', 3,000 %, due 9/1/2049	102	0,04
300	Fannie Mae Pool 'CA4110', 3,000 %, due 9/1/2049	309	0,12
300	Fannie Mae Pool 'CA4121', 3,000 %, due 9/1/2049	308	0,12
100	Fannie Mae Pool 'FM1341', 3,000 %, due 8/1/2049	102	0,04
1.732	Fannie Mae Pool 'MA2806', 3,000 %, due 11/1/2046	1.784	0,68
90	Fannie Mae Pool 'MA3383', 3,500 %, due 6/1/2048	93	0,04
490	Fannie Mae Pool 'MA3686', 3,500 %, due 6/1/2049	505	0,19
200	Fannie Mae, 30 Jahre, TBA 3,000 % ∞±	206	0,08
300	Fannie Mae, 30 Jahre, TBA 3,000 % ∞±	308	0,12
728	Flagstar Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Klasse A4, 144A, 3,500 %, due 4/25/2048 *	740	0,28
350	Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000 %, due 2/1/2038	359	0,14
268	Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, due 4/1/2038	275	0,11
217	Freddie Mac Gold Pool 'G06496', 5,000 %, due 6/1/2041	239	0,09
94	Freddie Mac Gold Pool 'G61739', 3,000 %, due 9/1/2048	97	0,04
95	Freddie Mac Gold Pool 'Q58587', 3,500 %, due 9/1/2048	98	0,04
100	Freddie Mac Pool 'QA1597', 3,000 %, due 8/1/2049	102	0,04
99	Freddie Mac Pool 'RA1103', 3,000 %, due 7/1/2049	102	0,04
100	Freddie Mac Pool 'RA1343', 3,000 %, due 9/1/2049	103	0,04
500	Freddie Mac Pool 'RA1352', 3,000 %, due 9/1/2049	511	0,20
3.900	Freddie Mac Pool 'SD7504', 3,500 %, due 8/1/2049	4.055	1,55
306	Freddie Mac Pool 'ZS3940', 4,500 %, due 6/1/2038	332	0,13
228	Freddie Mac Pool 'ZS4727', 4,000 %, due 7/1/2047	239	0,09
87	Freddie Mac Pool 'ZS4755', 3,500 %, due 2/1/2048	90	0,03
339	Freddie Mac Pool 'ZS4790', 4,000 %, due 9/1/2048	353	0,13
353	Freddie Mac Pool 'ZT0711', 3,500 %, due 10/1/2048	364	0,14
855	Freddie Mac Pool 'ZT1710', 4,000 %, due 2/1/2049	887	0,34
1.240	Freddie Mac Pool 'ZT1863', 3,500 %, due 4/1/2049	1.274	0,49
200	Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ∞±	205	0,08
200	Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ∞±	204	0,08
100	Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ∞±	102	0,04
957	Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, due 6/15/2048	1.008	0,39
42	Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, due 9/15/2042	44	0,02
31	Ginnie Mae I Pool "AB2892", 3,000 %, due 9/15/2042	32	0,01
114	Ginnie Mae I Pool "AB9108", 3,000 %, due 10/15/2042	119	0,04
78	Ginnie Mae I Pool "AB9109", 3,000 %, due 10/15/2042	81	0,03
36	Ginnie Mae I Pool "AB9205", 3,000 %, due 11/15/2042	37	0,01
69	Ginnie Mae I Pool "AB9207", 3,000 %, due 11/15/2042	71	0,03
446	Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, due 6/20/2044	470	0,18
66	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, due 6/20/2047	70	0,03
17	Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000 %, due 11/20/2047	18	0,01
76	Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, due 11/20/2047	80	0,03
259	Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, due 2/20/2048	270	0,10
455	Ginnie Mae II Pool 'MA5135', 3,000 %, due 4/20/2048	470	0,18
81	Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4.000 %, due 4/20/2048	84	0,03
163	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4.500 %, due 6/20/2048	171	0,07
83	Ginnie Mae II Pool 'MA5330', 4.000 %, due 7/20/2048	87	0,03
227	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4.500 %, due 7/20/2048	238	0,09
78	Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4.500 %, due 9/20/2048	82	0,03
177	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4.500 %, due 1/20/2049	185	0,07
380	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5.000 %, due 1/20/2049	400	0,15
1.705	Ginnie Mae II Pool 'MA5876', 4.000 %, due 4/20/2049	1.781	0,68
500	Ginnie Mae II, 30 Year March TBA± 3,000 %)	515	0,20
1.100	Ginnie Mae II, 30 Year March TBA± 3,000 %)	1.134	0,43
2.500	Ginnie Mae II, 30 Year March TBA± 3,500 %)	2.598	1,00
100	Ginnie Mae II, 30 Year March TBA± 4,000 %)	104	0,04
100	Ginnie Mae II, 30 Year March TBA± 4,500 %)	105	0,04
356	Jp Morgan Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Klasse A1, 144A, 3,500 %, due 10/25/2048 *	363	0,14
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 37.085)		37.661	14,44
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 24,62 % (28. Februar 2019: 25,30 %)			
Australien – 0,03 % (28. Februar 2019: 0,03 %)			
AUD 100	Westpac Banking Corp, 7,250 %, due 2/11/2020	69	0,03
Belgien – 0,21 % (28. Februar 2019: 0,19 %)			
300	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev NV Weltweit Inc., 4,900 %, due 2/1/2046	358	0,14
30	Anheuser-Busch InBev NV Finanzwesen, Inc., 2,625 %, due 1/17/2023	31	0,01
150	Anheuser-Busch InBev NV Weltweit Inc., 4,150 %, due 1/23/2025	164	0,06
		553	0,21
Brasilien – 0,25 % (28. Februar 2019: 0,25 %)			
580	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, due 3/17/2024	647	0,25
Kanada – 0,11 % (28. Februar 2019: 0,02 %)			
270	1011778 v. Chr. ULC / Neu Red Finance Inc, 144A, 4,250 %, due 5/15/2024	279	0,11
China – 0,22 % (28. Februar 2019: 0,23 %)			
EUR 510	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 1,750 %, due 6/14/2022	581	0,22
Kolumbien – 0,98 % (28. Februar 2019: 0,97 %)			
138	Ecopetrol SA, 5,875 %, due 9/18/2023	154	0,06
2.280	Ecopetrol SA, 4,125 %, due 1/16/2025	2.397	0,92
		2.551	0,98
Frankreich – 1,33 % (28. Februar 2019: 1,11 %)			
EUR 96	Altice France SA/Frankreich, 5,625 %, due 5/15/2024	109	0,04
210	Altice France SA/Frankreich, 144A 7,375 %, due 5/1/2026	225	0,09
EUR 680	BNP Paribas SA 2,875 %, due 3/20/2026 *	781	0,30

^ 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^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Frankreich – (Fortsetzung)			
560	BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, due 1/10/2030 *	661	0,25
EUR 1.150	Credit Agricole SA, 2,625 %, due 3/17/2027	1.456	0,56
200	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, due 9/17/2044	241	0,09
		3.473	1,33
Deutschland – 1,43 % (28. Februar 2019: 1,23 %)			
EUR 400	Allianz Finance II BV, 5,750 %, due 7/8/2041 *	487	0,19
EUR 400	Bayer Capital Corp BV, 0,625 %, due 12/15/2022	449	0,17
GBP 250	Innogy Finance BV, 5,625 %, due 12/6/2023	360	0,14
GBP 100	Muchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 6,625 %, due 5/26/2042 *	138	0,05
EUR 500	Muchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, due 5/26/2049 *	667	0,25
EUR 1.420	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, due 10/1/2024	1.636	0,63
		3.737	1,43
Israel – 0,24 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
700	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, due 12/18/2022	613	0,24
Italien – 0,28 % (28. Februar 2019: 0,05 %)			
EUR 100	Intesa Sanpaolo Spa, 1,125 %, due 3/4/2022	113	0,05
EUR 370	Telecom Italia Finance SA, 7,750 %, due 1/24/2033	608	0,23
		721	0,28
Mexiko – 0,09 % (28. Februar 2019: 0,09 %)			
230	Mexichem SAB de CV, 4,875 %, due 9/19/2022	242	0,09
Niederlande – 1,49 % (28. Februar 2019: 1,53 %)			
EUR 800	ABN AMRO BANK NV, 7,125 %, due 7/6/2022	1.056	0,41
500	Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, due 12/1/2023	541	0,21
EUR 200	ING Groep NV, 3,000 %, due 4/11/2028 *	241	0,09
EUR 1.500	ING Groep NV, 2,500 %, due 2/15/2029 *	1.795	0,69
200	Shell International Finance BV, 4,375 %, due 5/11/2045	245	0,09
		3.878	1,49
Norwegen – 0,34 % (28. Februar 2019: 0,36 %)			
EUR 790	DnB Nor Bank ASA, 1,125 %, due 3/20/2028 *	895	0,34
Peru – 0,11 % (28. Februar 2019: 0,10 %)			
250	Southern Copper Corp, 5,250 %, due 11/8/2042	289	0,11
Singapur – 0,12 % (28. Februar 2019: 0,12 %)			
300	DBS Group Holdings Ltd, 4,520 %, due 12/11/2028 *	321	0,12
Südafrika – 0,19 % (28. Februar 2019: 0,19 %)			
EUR 420	Anglo American Capital Plc, 1,625 %, due 9/18/2025	497	0,19
Spanien – 0,50 % (28. Februar 2019: 1,04 %)			
EUR 600	Banco Santander SA, 3,250 %, due 4/4/2026	764	0,29
EUR 400	Telefonica Emiliones, 2,9320 % Eseur 17/10/29 Eur, 2,932 %, due 10/17/2029	547	0,21
		1.311	0,50
Schweden – 0,29 % (28. Februar 2019: 0,59 %)			
EUR 660	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, due 3/2/2028 *	753	0,29
Schweiz – 0,95 % (28. Februar 2019: 0,72 %)			
EUR 651	Glencore Finance Europe Ltd, 1,875 %, due 9/13/2023	760	0,29
90	Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, due 3/27/2027	93	0,04
EUR 550	Holcim Finance Luxemburger SA, 1,750 %, due 8/29/2029	660	0,25
EUR 800	Finanzierung der UBS Group Schweiz AG, 1,500 %, due 11/30/2024	936	0,36
GBP 20	Zürich Finance UK Plc, 6,625 %, Perpetual *	27	0,01
		2.476	0,95
Großbritannien – 3,71 % (28. Februar 2019: 4,57 %)			
GBP 670	Aviva Plc, 6,125 %, due 11/14/2036 *	964	0,37
GBP 100	Aviva Plc, 5,125 %, due 6/4/2050 *	137	0,05
GBP 210	Aviva Plc, 6,875 %, due 5/20/2058 *	350	0,13
GBP 280	BAE Systems Plc, 4,125 %, due 6/8/2022	368	0,14
EUR 460	OTP Bank Plc, 6,000 %, due 1/14/2021	543	0,21
EUR 2.020	Barclays Plc, 2,625 %, due 11/11/2025 *	2.252	0,86
100	BP Capital Markets Plc, 3,506 %, due 3/17/2025	107	0,04
GBP 470	Phones4u Finance Plc, 5,000 %, due 4/25/2023	628	0,24
565	HSBC Holdings Plc, 4,250 %, due 8/18/2025	598	0,23
GBP 100	HSBC Holdings Plc, 7,000 %, due 4/7/2038	181	0,07
EUR 63	OTP Bank Plc, 6,500 %, due 3/24/2020	72	0,03
GBP 1.000	OTP Bank Plc, 7,625 %, due 4/22/2025	1.560	0,60
490	Santander UK Plc, 144A, 5,000 %, due 11/7/2023	519	0,20
GBP 260	Scottish Widows Ltd, 5,500 %, due 6/16/2023	354	0,14
EUR 420	Sky Ltd, 2,250 %, due 11/17/2025	528	0,20
230	Standard Chartered Plc, 144A, 5,700 %, due 3/26/2044	289	0,11
230	Virgin Media Gesichert Finance Plc, 144A, 5,500 %, due 5/15/2029	241	0,09
		9.691	3,71
USA – 11,75 % (28. Februar 2019: 11,91 %)			
30	AbbVie Inc., 2,900 %, due 11/6/2022	31	0,01
EUR 120	Allergan Funding SCS, 1,500 %, due 11/15/2023	140	0,05
310	Allergan Funding SCS, 3,800 %, due 3/15/2025	326	0,13
40	American International Gruppe Inc., 4,500 %, due 7/16/2044	46	0,02
10	Apache Corp, 4,750 %, due 4/15/2043	10	-
20	AT&T Inc., 3,875 %, due 8/15/2021	21	0,01
214	AT&T Inc., 4,500 %, due 3/9/2048	235	0,09
20	Bank of America Corp, 3,300 %, due 1/11/2023	21	0,01
70	Bank of America Corp, 4,100 %, due 7/24/2023	75	0,03
32	Bank of America Corp, 3,004 %, due 12/20/2023 *	33	0,01
150	Bank of America Corp, 4,200 %, due 8/26/2024	162	0,06
330	Bank of America Corp, 4,250 %, due 10/22/2026	361	0,14
2.299	Bank of America Corp, 3,419 %, due 12/20/2028 *	2.434	0,93
97	Becton Dickinson und Co, 3,734 %, due 12/15/2024	103	0,04
160	BP Capital Markets America Inc., 3,245 %, due 5/6/2022	165	0,06
100	Chesapeake Energy Corp, 6,625 %, due 8/15/2020	100	0,04
30	Citigroup Inc., 3,500 %, due 5/15/2023	31	0,01
EUR 290	Citigroup Inc., 1,750 %, due 1/28/2025	348	0,13
250	Citigroup Inc., 5,500 %, due 9/13/2025	287	0,11
500	Citigroup Inc., 4,600 %, due 3/9/2026	551	0,21
560	Citigroup Inc., 4,300 %, due 11/20/2026	612	0,23
360	Citigroup Inc., 4,450 %, due 9/29/2027	396	0,15
326	Citigroup Inc., 8,125 %, due 7/15/2039	546	0,21
93	Citigroup Inc., 5,300 %, due 5/6/2044	119	0,05
185	Citigroup Inc., 4,650 %, due 7/30/2045	231	0,09
66	Comcast Corp, 3,999 %, due 11/1/2049	75	0,03
97	Comcast Corp, 4,049 %, due 11/1/2052	111	0,04
500	CSC HOLDINGS LLC, 144A, 5,375 %, due 7/15/2023	515	0,20
2.140	CRC Health Corp, 4,100 %, due 3/25/2025	2.292	0,88
430	Devon Energy Corp, 5,850 %, due 12/15/2025	515	0,20
270	Gericht DBS Corp, 5,875 %, due 11/15/2024	258	0,10
60	Duke Energy Progress LLC, 4,375 %, due 3/30/2044	72	0,03
20	Enterprise-Produkte Operating LLC, 3,350 %, due 3/15/2023	21	0,01
20	Enterprise-Produkte Operating LLC, 5,100 %, due 2/15/2045	24	0,01
10	Exelon Corp, 5,625 %, due 6/15/2035	13	0,01
20	FirstEnergy Corp, Serie B, 4,250 %, due 3/15/2023	21	0,01
215	FirstEnergy Corp, Serie C, 7,375 %, due 11/15/2031	308	0,12
100	Freeport-Mc Moran Inc., 6,875 %, due 2/15/2023	105	0,04
310	Freeport-Mc Moran Inc., 4,550 %, due 11/14/2024	314	0,12
80	Freeport-Mc Moran Inc., 5,450 %, due 3/15/2043	73	0,03
EUR 540	GE Capital European Finanzierung Unlimited Co, 0,800 %, due 1/21/2022	595	0,23
325	GE Capital International Finanzierung Co Unlimited Co, 4,418 %, due 11/15/2035	331	0,13
442	General Electric Co, 6,875 %, due 1/10/2039	564	0,22
50	General Motors Co, 6,600 %, due 4/1/2036	58	0,02
10	General Motors Co, 5,200 %, due 4/1/2045	10	-
20	General Motors Co, 6,750 %, due 4/1/2046	24	0,01
120	General Motors Co, Co Inc., 4,375 %, due 9/25/2021	124	0,05
250	Gilead Sciences Inc., 4,800 %, due 4/1/2044	302	0,12
70	Gilead Sciences Inc., 4,750 %, due 3/1/2046	85	0,03
GBP 201	Goldman Sachs Group Inc/The, Der, 5,500 %, due 10/12/2021	266	0,10
400	Goldman Sachs Group Inc/The, Der, 3,850 %, due 7/8/2024	427	0,16

^ *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^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)			wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)				
USA – (Fortsetzung)				
	800	Goldman Sachs Group Inc/The, Der, 6,750 %, due 10/1/2037	1.097	0,42
	640	Goldman Sachs Group Inc/The, Der, 6,250 %, due 2/1/2041	909	0,35
	380	Goldman Sachs Group Inc/The, Der, 5,150 %, due 5/22/2045	462	0,18
	70	BCE Inc., 7,500 %, due 2/15/2022	79	0,03
	570	BCE Inc., 5,000 %, due 3/15/2024	623	0,24
	380	BCE Inc., 5,250 %, due 6/15/2026	429	0,16
	170	BCE Inc., 4,500 %, due 2/15/2027	185	0,07
	110	BCE Inc., 5,625 %, due 9/1/2028	125	0,05
	150	ILFC E-Capital Trust I, 144A, 4,090 %, due 12/21/2065 *	105	0,04
	790	JPMorgan Chase & Co, 3,200 %, due 1/25/2023	821	0,31
	80	JPMorgan Chase & Co, 3,625 %, due 5/13/2024	86	0,03
	200	JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, due 12/15/2026	220	0,08
	680	JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, due 10/1/2027	760	0,29
	300	JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, due 12/5/2029 *	345	0,13
GBP	502	Kraft Heinz Foods Co, 4,125 %, due 7/1/2027	674	0,26
	960	Lehman Brothers Holdings Escrow Des Capital Trust, zero coupon,Perpetual †∞ ε	-	-
	177	Lehman Escrow Beleg, zero coupon,Perpetual †∞	2	-
EUR	490	ADIENT GLOBAL HOLDINGS SCA, 1,125 %, due 3/7/2027	576	0,22
	29	Medtronic Inc., 4,625 %, due 3/15/2045	38	0,01
	40	MetLife Inc., 6,400 %, due 12/15/2036	47	0,02
	580	Morgan Stanley, 4,431 %, due 1/23/2030 *	661	0,25
	210	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp, 5,000 %, due 10/15/2027	225	0,09
	220	Netflix Inc., 5,375 %, due 2/1/2021	228	0,09
	230	Netflix Inc., 5,500 %, due 2/15/2022	246	0,09
	170	NGPL PIPECO LLC, 144A, 4,875 %, due 8/15/2027	181	0,07
	270	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, due 8/15/2029	275	0,11
	10	EOG Resources Inc., 6,875 %, due 3/1/2021	10	-
	90	Targa Resources Corp, 5,750 %, due 6/1/2021	90	0,03
	10	Targa Resources Corp, 5,000 %, due 3/15/2023	9	-
	180	Sprint Communications Inc., 11,500 %, due 11/15/2021	212	0,08
	510	Targa Resources Corp, LP-/Targa-Ressourcen Partner Finance Corp, 5,875 %, due 4/15/2026	536	0,21
	70	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Corp, Finance Corp, 144A, 6,875 %, due 1/15/2029	78	0,03
	4	Lehrerversicherung & Annuity Association of Amerika, 6,850 %, due 12/16/2039	6	-
	170	Time Warner Cable LLC, 4,125 %, due 2/15/2021	174	0,07
	40	Time Warner Cable LLC, 6,750 %, due 6/15/2039	49	0,02
	90	T-Mobile USA Inc, 4,000 %, due 4/15/2022	93	0,04
	820	United Rentals North Amerika Inc., 4,625 %, due 7/15/2023	841	0,32
	30	United Rentals North Amerika Inc., 6,500 %, due 12/15/2026	33	0,01
	160	United Rentals North Amerika Inc., 5,500 %, due 5/15/2027	172	0,07
	133	Verizon Communications Inc., 4,329 %, due 9/21/2028	153	0,06
	50	Verizon Communications Inc., 5,250 %, due 3/16/2037	63	0,02
	10	Verizon Communications Inc., 4,862 %, due 8/21/2046	13	-
	10	Verizon Communications Inc., 5,500 %, due 3/16/2047	13	0,01
	100	Verizon Communications Inc., 4,522 %, due 9/15/2048	121	0,05
	340	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, due 2/15/2028	350	0,13
	2.110	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual *	2.113	0,81
	43	Wells Fargo & Co, 4,480 %, due 1/16/2024	47	0,02
	880	Wells Fargo & Co, 3,900 %, due 5/1/2045	1.031	0,40
	140	CVR Energy Inc., 8,250 %, due 8/1/2023	156	0,06
			30.649	11,75
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 61.150)			64.226	24,62
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 55,98 % (28. Februar 2019: 54,30 %)				
Belgien – 1,48 % (28. Februar 2019: 1,23 %)				
EUR	890	Königreich Belgien Staatsanleihen, Serie 71, 3,750 %, due 6/22/2045	1.807	0,69
EUR	1.400	Königreich Belgien Staatsanleihen, Serie 88, 144A, 1,700 %, due 6/22/2050	2.060	0,79
			3.867	1,48
Brasilien – 0,87 % (28. Februar 2019: 0,67 %)				
	2.130	Brasilianische Regierung Internationale Anleihe, 5,000 %, due 1/27/2045	2.270	0,87
Kanada – 2,52 % (28. Februar 2019: 2,57 %)				
CAD	8.270	Anleihe Der Kanadischen Regierung, 2,250 %, due 6/1/2025	6.579	2,52
Kolumbien – 0,22 % (28. Februar 2019: 0,19 %)				
	230	Regierung Kolumbiens Internationale Anleihe, 5,625 %, due 2/26/2044	297	0,11
	230	Regierung Kolumbiens Internationale Anleihe, 5,000 %, due 6/15/2045	278	0,11
			575	0,22
Frankreich – 3,87 % (28. Februar 2019: 3,84 %)				
EUR	3.170	Regierung Der Französischen Republik OAT-Bindung, 0,250 %, due 11/25/2026	3.703	1,42
EUR	4.080	Regierung Der Französischen Republik Bond OAT, Serie OATe, 1,850 %, due 7/25/2027 β	6.387	2,45
			10.090	3,87
Deutschland – 0,34 % (28. Februar 2019: 0,53 %)				
EUR	280	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, due 2/15/2027	334	0,13
EUR	290	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,500 %, due 8/15/2046	564	0,21
			898	0,34
Indonesien – 2,40 % (28. Februar 2019: 2,43 %)				
IDR	84.339.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR79, 8,375 %, due 4/15/2039	6.251	2,40
Italien – 3,54 % (28. Februar 2019: 3,43 %)				
EUR	10	Italien Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,000 %, due 12/1/2025	12	-
EUR	60	Italien Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,050 %, due 8/1/2027	73	0,03
EUR	1.070	Italien Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 2,550 %, due 9/15/2041 β	1.778	0,68
EUR	70	Italien Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 4,750 %, due 9/1/2044	119	0,05
EUR	5.160	Italien Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250 %, due 9/1/2046	7.257	2,78
			9.239	3,54
Japan – 5,35 % (28. Februar 2019: 4,83 %)				
JPY	611.050	Japanische Regierung Zehn Jahresanleihe, Serie 341, 0,300 %, due 12/20/2025	5.999	2,30
JPY	63.350	Japanische Regierung Zwanzigjährige Anleihe, Serie 128, 1,900 %, due 6/20/2031	746	0,29
JPY	24.400	CPI der japanischen Regierung Verknüpfte Anleihe, Serie 19, 0,100 %, due 9/10/2024 β	239	0,09
JPY	704.000	CPI der japanischen Regierung Verknüpfte Anleihe, Serie 21, 0,100 %, due 3/10/2026 β	6.959	2,67
			13.943	5,35
Kuwait – 0,50 % (28. Februar 2019: 0,48 %)				
	1.190	Kuwait International Staatsanleihen, 3,500 %, due 3/20/2027	1.308	0,50
Mexiko – 4,64 % (28. Februar 2019: 3,78 %)				
MXN	170.859	Mexican Bonos, Series M 20, 7,750 %, due 11/13/2042	8.796	3,37
EUR	1.100	Regierung Mexikos Internationale Anleihe, 2,875 %, due 4/8/2039	1.376	0,53
	1.780	Regierung Mexikos Internationale Anleihe, 4,600 %, due 1/23/2046	1.930	0,74
			12.102	4,64
Norwegen – 0,98 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
EGP	22.000	Regierung Norwegens Bond, Serie 481, 144A, 1,750 %, due 9/6/2029	2.556	0,98
Polen – 3,01 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
PLN	29.090	Republik Polen Staatsanleihen, Serie 0428, 2,750 %, due 4/25/2028	7.863	3,01
Saudi-Arabien – 0,59 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
EUR	1.240	Saudische Regierung Internationale Anleihe, 2,000 %, due 7/9/2039	1.540	0,59
Südafrika – 1,01 % (28. Februar 2019: 1,07 %)				
ZAR	33.340	Republik Südafrika Staatsanleihen, Serie R214, 6,500 %, due 2/28/2041	1.545	0,59
	1.090	Republik Südafrika Regierung Internationale Anleihe, 4,300 %, due 10/12/2028	1.088	0,42
			2.633	1,01
Südkorea – 0,83 % (28. Februar 2019: 0,89 %)				
KRW	2.533.840	Korea Treasury Bond, Serie 2606, 1,875 %, due 6/10/2026	2.175	0,83

^ 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^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)			wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)				
Spanien – 2,18 % (28. Februar 2019: 1,26 %)				
EUR	1.920	Staatsanleihen Spaniens, 144A 1,450 %, due 10/31/2027	2.374	0,91
EUR	500	Staatsanleihen Spaniens, 144A 5,150 %, due 10/31/2044	1.083	0,41
EUR	1.420	Staatsanleihen Spaniens, Klasse 30Y, 144A, 2,700 %, due 10/31/2048	2.236	0,86
			5.693	2,18
Türkei – 0,88 % (28. Februar 2019: 1,33 %)				
TRY	10.370	Staatsanleihen Der Türkei, 10,500 %, due 8/11/2027	1.367	0,52
EUR	830	Regierung Der Türkei Internationale Anleihe, 5,200 %, due 2/16/2026	926	0,36
			2.293	0,88
Vereinigte Arabische Emirate - 0,65 % (28. Februar 2019 0,54 %)				
	1.350	Regierung Abu Dhabi Internationale Anleihe, 4,125 %, due 10/11/2047	1.682	0,65
Großbritannien – 2,49 % (28. Februar 2019: 1,90 %)				
GBP	820	Vereinigtes Königreich Gilt, 4,500 %, due 9/7/2034	1.536	0,59
GBP	2.490	Vereinigtes Königreich Gilt, 4,250 %, due 12/7/2040	4.961	1,90
			6.497	2,49
USA – 17,63 % (28. Februar 2019: 23,33 %)				
	7.860	Us-Schatzanleihen Indizierte Anleihen, 0,500 %, due 4/15/2024 β	8.151	3,12
	200	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 1,375 %, due 1/15/2020	200	0,08
	450	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 1,750 %, due 3/31/2022	453	0,17
	20	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 1,875 %, due 3/31/2022	20	0,01
	1.790	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 1,750 %, due 6/30/2022	1.806	0,69
	15.600	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 1,625 %, due 8/15/2022	15.690	6,01
	4.820	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 2,250 %, due 12/31/2024	5.025	1,93
	1.150	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 1,375 %, due 8/31/2026	1.144	0,44
	1.090	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 2,875 %, due 8/15/2045	1.294	0,50
	6.560	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 3,000 %, due 11/15/2045	7.971	3,06
	260	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 2,750 %, due 8/15/2047	304	0,12
	10	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 2,750 %, due 11/15/2047	12	–
	300	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 3,125 %, due 5/15/2048	376	0,14
	2.940	United States Treasury Note/Bond, Anleihe, 2,875 %, due 5/15/2049	3.542	1,36
			45.988	17,63
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 139.568)			146.042	55,98
Investmentfonds - 9,25 % (28. Februar 2019: 9,00 %)				
	630	Western Asset China Bond Fund – Klasse M	7.658	2,94
	41	Legg Mason Investments Investor Funds (II) Plc - Legg Mason Western Asset Indien India Bond Fund – Klasse LM USD Thesaurierend	5.195	1,99
	11.265	Western Asset Liquidity Funds PLC - Western Asset US-Dollar Fund – Klasse WA (ausschüttend)	11.265	4,32
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 23.825)			24.118	9,25
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 261.850)			272.268	104,37

Kontrakte (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Gekaufte Optionen – 0,01 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
EUR	–	Euro-BPT Future November 2019 Put 136,50, due 10/25/2019	28	0,01
Gekaufte Optionen insgesamt (Anschaffungskosten USD 36)			28	0,01
Devisenterminkontrakte – 0,60 % (28. Februar 2019: 0,64 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			1.565	0,60
Futures – 0,44 % (28. Februar 2019: 0,19 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			1.142	0,44
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte			275.003	105,42
Verkaufte Optionen – (0,23 %) (28. Februar 2019: 0,07 %)				
EUR	-	Euro-BPT Future November 2019 Call 145,00, due 10/25/2019	(53)	(0,02)
EUR	-	Euro-Bund Juni 2019 Put 174,00, due 9/20/2019	(8)	–
	-	IMM EUR Dezember 2019 Anruf 97.25, fällig am 12/16/2019	(140)	(0,05)
	-	U.S. 10 Year April 2019 Call 130,00, due 9/20/2019	(307)	(0,12)
	-	U.S. 10 Year April 2019 Call 131,50, due 9/20/2019	(42)	(0,02)
	-	US-Bond November 2019 Call 166,00, due 10/25/2019	(61)	(0,02)
Veräußerte Optionen gesamt (Anschaffungskosten USD (342))			(611)	(0,23)
Devisenterminkontrakte – (0,68 %) (28. Februar 2019: 0,18 %)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(1.763)	(0,68)

Kontrakte (in Tsd.)	wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Futures – (0,80 %) (28. Februar 2017: 0,76 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(2.077)	(0,80)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	(4.451)	(1,71)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	270.552	103,71
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	(9.690)	(3,71)
Gesamtnettovermögen	USD 260.862	100,00

- Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf USD 0, weniger als USD 1.000, 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 28. Februar 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 24.343.000 und machten 9,33 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

† Illiquide.

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

ε Für das Wertpapier besteht am 31. August 2019 Zahlungsausfall.

± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

CPI	–	CP – Verbraucherpreisindex (Consumer Price Index)
Perpetual	–	Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen
TBA	–	To Be Announced (wird angekündigt)
AUD	–	Australische Dollar
CAD	–	Kanadischer Dollar
EUR		Euro
GBP	–	Britisches Pfund
IDR	–	Indonesische Rupiah
JPY	–	Japanischer Yen
KRW	–	Südkoreanische Won
MXN	–	Mexikanische Peso
NOK	–	Norwegische Kronen
PLN	–	Polnischer Zloty
TRY	–	Türkische Lira
ZAR	–	Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	83,12
Investmentfonds	8,08
Derivate	0,92
Sonstige Vermögenswerte	7,88
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
04.09.2019	BNY Mellon	Kauf	EUR	15	Verkauf	USD	17	USD	–
12.09.2019	BNY Mellon	Kauf	USD	29	Verkauf	EUR	26		–
12.09.2019	BNY Mellon	Kauf	CAD	130.342	Verkauf	USD	98.242		(328)
12.09.2019	BNY Mellon	Kauf	EUR	46.886	Verkauf	USD	52.666		(1.094)
12.09.2019	BNY Mellon	Kauf	NZD	5.935	Verkauf	USD	3.841		(100)
21.10.2019	Citi	Kauf	USD	4.611	Verkauf	KRW	5.572.405		1

^ *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^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
21.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	2.420	Verkauf	CNH	17.070	USD	40
21.10.19	JP Morgan	Kauf	RUB	157.181	Verkauf	USD	2.364		(24)
21.11.19	Citi	Kauf	USD	3.382	Verkauf	EUR	3.012		50
21.11.19	Citi	Kauf	ZAR	2.710	Verkauf	USD	175		2
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	14.696	Verkauf	EUR	13.005		315
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.431	Verkauf	MXN	48.556		41
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.093	Verkauf	PLN	4.217		32
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.670	Verkauf	TRY	15.515		89
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	NOK	16.607	Verkauf	USD	1.864		(39)
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	TRY	7.300	Verkauf	USD	1.214		-
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	JPY	209.210	Verkauf	USD	2.004		(23)
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	AUD	4.701	Verkauf	USD	3.189		(16)
21.11.19	HSBC	Kauf	USD	16.977	Verkauf	EUR	15.042		343
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	4.935	Verkauf	AUD	7.303		6
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	1.698	Verkauf	CAD	2.257		1
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	18.834	Verkauf	EUR	16.737		325
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	7.201	Verkauf	GBP	5.947		(59)
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	13.503	Verkauf	JPY	1.421.775		44
21.11.19	JP Morgan	Kauf	ZAR	7.480	Verkauf	USD	483		5
21.11.19	JP Morgan	Kauf	PLN	5.393	Verkauf	USD	1.385		(28)
21.11.19	JP Morgan	Kauf	SEK	17.630	Verkauf	USD	1.847		(42)
21.11.19	JP Morgan	Kauf	NOK	2.200	Verkauf	USD	246		(5)
21.11.19	Morgan Stanley	Kauf	AUD	2.220	Verkauf	USD	1.504		(5)
21.11.19	UBS	Kauf	USD	11.418	Verkauf	EUR	10.137		208
21.11.19	UBS	Kauf	USD	2.232	Verkauf	MXN	44.161		58
21.11.19	UBS	Kauf	USD	239	Verkauf	PLN	934		5
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): 1.594 USD)									1.565
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (434))									(1.763)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): 1.160 USD)								USD	(198)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
90 Day Euro$ December 2019	(25)	USD (6.134)	USD	(56)
Australia 10 Year Bond March 2019	20	2.004		83
Euro-Bobl March 2019	(17)	(2.545)		(48)
Euro-BTP September 2019	40	6.388		506
Euro-Bund Juni 2019	(218)	(42.236)		-
Euro-Bund Juni 2019	(175)	(34.447)		(1.575)
Euro-Buxl 30 Jahre Bond September 2019	8	1.972		242
Euro-OAT September 2019	(34)	(6.367)		(306)
Euro-Schatz September 2019	(9)	(1.114)		(6)
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2019	4	5.844		64
Long Gilt June 2019	(43)	(7.026)		(27)
U.S. 10 Year Note (CBT) March 2019	(86)	(11.328)		(46)
10 Jahre Ultra Note Dezember 2019 in den USA	(11)	(1.589)		(5)
U.S. 5 Year Note (CBT) March 2019	(26)	(3.119)		(8)
U.S. Long Bond (CBT) March 2019	83	13.716		108
U.S. Ultra Bond (CBT) March 2019	63	12.439		139
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): 483 USD)			USD	1.142
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (1.904))				(2.077)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (1.421))			USD	(935)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Asset-Backed Securities - 0,73 % (28. Februar 2019 0,79 %)			
140	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Serie 2018 4, Klasse A, 4,060 %, due 11/15/2030	157	0,21
420	SLM Student Loan Trust 2006-10, Serie 2006 10, Klasse A6, 2,433 %, due 3/25/2044 *	403	0,52
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 546)		560	0,73
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 78,40 % (28. Februar 2019: 84,84 %)			
Australien – 0,12 % (28. Februar 2019: 0,48 %)			
80	Westpac Banking Corp. 4,421 %, due 7/24/2039	90	0,12
Belgien – 1,76 % (28. Februar 2019: 1,92 %)			
320	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev NV Weltweit Inc., 4,900 %, due 2/1/2046	382	0,49
540	Anheuser-Busch InBev NV Weltweit Inc., 4,600 %, due 4/15/2048	629	0,82
EUR 300	CDON Group AB 1,875 %, due 3/11/2027 *	344	0,45
		1.355	1,76
Brasilien – 2,37 % (28. Februar 2019: 2,24 %)			
310	Braskem Finance Ltd, 6,450 %, due 2/3/2024	341	0,44
330	Petrobras Global Finance BV, 6,900 %, due 3/19/2049	375	0,49
300	Suzano Österreich GmbH, 7,000 %, due 3/16/2047	349	0,45
295	Vale Overseas Ltd, 8,250 %, due 1/17/2034	401	0,52
EUR 300	Vale SA, 3,750 %, due 1/10/2023	358	0,47
		1.824	2,37
Kanada – 0,17 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
110	Bell Canada Inc., 4,300 %, due 7/29/2049	130	0,17
China – 1,81 % (28. Februar 2019: 1,97 %)			
700	China Overseas Finance Cayman VII Ltd, 4,250 %, due 4/26/2023	740	0,96
EUR 340	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 1,750 %, due 6/14/2022	388	0,51
260	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 3,500 %, due 7/19/2022	263	0,34
		1.391	1,81
Kolumbien – 0,52 % (28. Februar 2019: 0,50 %)			
340	Ecopetrol SA, 5,875 %, due 5/28/2045	401	0,52
Denmark – 1,10 % (28. Februar 2019: 0,86 %)			
270	Danske Bank A/S, 5,375 %, due 1/12/2024	298	0,39
EUR 200	Danske Bank A/S, 2,500 %, due 6/21/2029 *	233	0,30
EUR 280	Danske Bank A/S, 5,750 %, Perpetual *	314	0,41
		845	1,10
Frankreich – 3,66 % (28. Februar 2019: 4,69 %)			
EUR 490	AXA SA, 3,250 %, due 5/28/2049 *	621	0,81
200	BNP Paribas SA, 4,705 %, due 1/10/2025 *	217	0,28
GBP 220	Credit Agricole SA, 7,500 %, Perpetual *	309	0,40
400	Engie SA, 2,875 %, due 10/10/2022	410	0,53
EUR 310	GELF Bond Emittent I SA, 1,125 %, due 7/18/2029	353	0,46
EUR 300	Orange SA, 1,375 %, due 9/4/2049	324	0,42
330	Pernod Ricard SA, 4,450 %, due 1/15/2022	348	0,45
200	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 4,750 %, due 9/17/2044	241	0,31
		2.823	3,66
Deutschland – 4,08 % (28. Februar 2019: 5,37 %)			
EUR 300	Allianz Finance II BV, 5,750 %, due 7/8/2041 *	365	0,47
EUR 400	Allianz SE, 4,750 %, Perpetual *	513	0,67
500	Deutsche Telekom International Finance BV, 2,820 %, due 1/19/2022	507	0,66
250	Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, due 6/15/2030	373	0,48
EUR 200	Hannover Finance Luxemburger SA, 5,750 %, due 9/14/2040 *	233	0,30
EUR 200	Muchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, due 5/26/2049 *	267	0,35
EUR 400	SAP SE, 0,250 %, due 3/10/2022	446	0,58
EUR 380	Caterpillar Financial Services AG, 1,500 %, due 10/1/2024	438	0,57
		3.142	4,08
Hongkong – 0,27 % (28. Februar 2019: 0,28 %)			
200	AIA Group Ltd, 144A, 3,200 %, due 3/11/2025	208	0,27
Irland – 0,44 % (28. Februar 2019: 0,81 %)			
310	CRH America Finance Inc., 4,500 %, due 4/4/2048	340	0,44
Italien – 2,28 % (28. Februar 2019: 1,50 %)			
270	Enel Finance International NV, 6,000 %, due 10/7/2039	334	0,43
EUR 380	Intesa Sanpaolo Spa, 1,000 %, due 7/4/2024	429	0,56
EUR 300	Telecom Italia Finance SA, 7,750 %, due 1/24/2033	493	0,64
EUR 230	UniCredit Spa, 1,250 %, due 6/25/2025 *	261	0,34
EUR 200	UniCredit Spa, 7,500 %, Perpetual *	241	0,31
		1.758	2,28
Japan – 1,63 % (28. Februar 2019: 1,79 %)			
1.050	Mitsubishi UFJ Financial Gruppe Inc., 3,218 %, due 3/7/2022	1.077	1,40
EUR 160	Mitsubishi UFJ Financial Gruppe Inc., 0,680 %, due 1/26/2023	180	0,23
		1.257	1,63
Luxemburg – 1,77 % (28. Februar 2019: 1,37 %)			
300	ArcelorMittal 6,250 %, due 2/25/2022	326	0,42
160	ArcelorMittal 4,550 %, due 3/11/2026	168	0,22
EUR 230	Logicor Finanzierung Sarl, 3,250 %, due 11/13/2028	287	0,37
EUR 125	Prologueis International Finanzierung II SA, 1,750 %, due 3/15/2028	152	0,20
EUR 240	SELP Finance Sarl, 1,500 %, due 11/20/2025	280	0,36
EUR 130	SELP Finance Sarl, 1,500 %, due 12/20/2026	150	0,20
		1.363	1,77
Mexiko – 0,84 % (28. Februar 2019: 1,38 %)			
240	BBVA Bancomer SA/Texas, 6,750 %, due 9/30/2022	260	0,34
400	BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, due 1/18/2033 *	384	0,50
		644	0,84
Niederlande – 3,40 % (28. Februar 2019: 4,89 %)			
EUR 394	ABN AMRO BANK NV, 7,125 %, due 7/6/2022	520	0,68
EUR 300	ABN AMRO BANK NV, 4,750 %, Perpetual *	345	0,45
EUR 310	Cooperatieve Rabobank UA/NY, 2,500 %, due 5/26/2026 *	356	0,46
EUR 100	Heineken Holding NV, 0,750 %, due 7/2/2031	116	0,15
EUR 140	Euronext NV, 1,000 %, due 4/18/2025	162	0,21
EUR 200	ING Groep NV, 3,000 %, due 4/11/2028 *	241	0,31
EUR 300	ING Groep NV, 2,500 %, due 2/15/2029 *	359	0,47
250	ING Groep NV, 6,750 %, Perpetual *	263	0,34
EUR 110	Vesteda Finance BV, 2,000 %, due 7/10/2026	134	0,17
EUR 100	Vesteda Finance BV, 1,500 %, due 5/24/2027	119	0,16
		2.615	3,40
Norwegen – 0,44 % (28. Februar 2019: 0,48 %)			
320	DnB Nor Bank ASA, 6,500 %, Perpetual *	337	0,44
Russland – 0,49 % (28. Februar 2019: 0,51 %)			
350	Lukoil International Finance BV, 4,750 %, due 11/2/2026	382	0,49
Südafrika – 0,49 % (28. Februar 2019: 0,50 %)			
350	Anglo American Capital 4,750 %, due 4/10/2027	379	0,49
Spanien – 3,36 % (28. Februar 2019: 4,74 %)			
EUR 300	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0,750 %, due 9/11/2022	338	0,44
EUR 200	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 5,875 %, Perpetual *	228	0,30
200	Banco Santander SA, 4,379 %, due 4/12/2028	220	0,29
200	Banco Santander SA 3,306 %, due 6/27/2029	210	0,27
EUR 200	Banco Santander SA, 5,250 %, Perpetual *	224	0,29
EUR 300	CaixaBank SA, 2,250 %, due 4/17/2030 *	342	0,44
EUR 200	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, 1,625 %, due 11/28/2025	236	0,31
EUR 200	Prosegur Cia de Seguridad SA, 1,000 %, due 2/8/2023	225	0,29
GBP 300	Telefonica Brasil SA, 5,597 %, due 3/12/2020	374	0,48
140	Telefonica Brasil SA, 7,045 %, due 6/20/2036	191	0,25
		2.588	3,36
Schweden – 0,75 % (28. Februar 2019: 1,85 %)			
EUR 320	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, due 3/2/2028 *	365	0,47
200	Svenska Handelsbanken AB, 6,250 %, Perpetual *	213	0,28
		578	0,75
Schweiz – 4,69 % (28. Februar 2019: 3,75 %)			
200	Credit Suisse Group AG 7,250 %, Perpetual *	213	0,28
280	Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, due 11/15/2041	323	0,42
EUR 370	Glencore Finance Europe Ltd, 1,875 %, due 9/13/2023	432	0,56
EUR 300	Holcim Finance Luxemburg SA, 1,750 %, due 8/29/2029	360	0,47
EUR 130	Holcim Finance Luxemburg SA, 3,000 %, Perpetual *	151	0,20
EUR 600	Swiss Re Finance Luxemburg SA, 2,534 %, due 4/30/2050 *	762	0,99
230	Syngenta Finance NV, 4,441 %, due 4/24/2023	241	0,31
EUR 102	UBS AG, 4,750 %, due 2/12/2026 *	119	0,15

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)				
Schweiz - (Fortsetzung)				
EUR	320	Finanzierung der UBS Group Schweiz AG, 1,750 %, due 11/16/2022	373	0,48
EUR	300	Finanzierung der UBS Group Schweiz AG, 1,500 %, due 11/30/2024	351	0,46
	270	Finanzierung der UBS Group Schweiz AG, 7,000 %, Perpetual *	286	0,37
			3.611	4,69
Großbritannien – 13,55 % (28. Februar 2019: 13,69 %)				
EUR	210	Annington Funding Plc, 1,650 %, due 7/12/2024	242	0,32
EUR	280	Barclays Plc 2,000 %, due 2/7/2028 *	303	0,39
	200	Barclays Plc 4,972 %, due 5/16/2029 *	220	0,29
	350	Barclays Plc 8,000 %, Perpetual *	364	0,47
	285	BP Capital Markets Plc, 3,561 %, due 3/6/2019	294	0,38
GBP	150	Phones4u Finance Plc 5,000 %, due 4/25/2023	200	0,26
GBP	190	Close Brothers Group Plc, 2,750 %, due 4/26/2023	241	0,31
GBP	250	Co-Operative Bank Plc/Die, 4,750 %, due 11/11/2021	323	0,42
GBP	220	CPUK Finance Ltd, 7,239 %, due 2/28/2024	328	0,43
GBP	500	CYBG Plc, 4,000 %, due 9/3/2027 *	605	0,79
GBP	310	Dignity Finance Plc, Serie B, 4,696 %, due 12/31/2049	324	0,42
EUR	250	FIAT Chrysler Automobiles NV, 3,750 %, due 3/29/2024	313	0,41
	230	HSBC Holdings Plc 5,100 %, due 4/5/2021	240	0,31
	290	HSBC Holdings Plc 4,583 %, due 6/19/2029 *	324	0,42
EUR	250	HSBC Holdings Plc 6,000 %, Perpetual *	311	0,40
GBP	260	HSBC Holdings Plc 5,875 %, Perpetual *	331	0,43
EUR	290	Informa-Sps, 1,500 %, due 7/5/2023	334	0,43
	200	OTP Bank Plc 12,000 %, Perpetual *	242	0,31
EUR	310	Lloyds Banking Group Plc 1,750 %, due 9/7/2028 *	340	0,44
	200	Lloyds Banking Group Plc 6,750 %, Perpetual *	203	0,26
GBP	200	Marstons Emittent Plc, Serie B1, 3,320 %, due 7/15/2035 *	208	0,27
GBP	200	Miller Homes Group Holdings Sps, 5,500 %, due 10/15/2024	246	0,32
EUR	450	Bundesweite Baugesellschaft, 1,500 %, due 3/8/2026 *	514	0,67
GBP	100	Prudential Plc 3,875 %, due 7/20/2049 *	124	0,16
	560	Schatzamt Von Reckitt Benckiser Services-Sps, 2,375 %, due 6/24/2022	564	0,73
EUR	450	Royal Bank of Scotland Sps, 2,500 %, due 3/22/2023	530	0,69
	200	Royal Bank of Scotland Sps, 4,269 %, due 3/22/2025 *	209	0,27
	500	Santander UK Group Holdings Plc, 4,750 %, due 9/15/2025	523	0,68
	260	Standard Chartered Plc 3,950 %, due 1/11/2023	266	0,35
GBP	190	Tesco Corporate Treasury Services-Sps, 2,500 %, due 5/2/2025	237	0,31
GBP	193	Tesco Property Finance 3 Plc, 5,744 %, due 4/13/2040	311	0,40
GBP	190	Gruppe Sps/Die, 3,500 %, due 10/15/2028	254	0,33
EUR	290	Pennon Group PLC 2,500 %, due 5/24/2039	370	0,48
			10.438	13,55
USA – 28,29 % (28. Februar 2019: 28,77 %)				
	140	Aetna Inc 2,800 %, due 6/15/2023	142	0,18
EUR	230	Allergan Funding SCS, 1,250 %, due 6/1/2024	265	0,34
	200	Allstate Corp/The, 6,500 %, due 5/15/2057 *	234	0,30
EUR	230	American Express Co Corp., 0,625 %, due 11/22/2021	258	0,34
EUR	190	American International Group Inc Inc 1,500 %, due 6/8/2023	220	0,29
	330	Amgen Inc 3,625 %, due 5/22/2024	351	0,46
	470	Anadarko Petroleum Corp 6,600 %, due 3/15/2046	623	0,81
	140	Hymne Inc, 3,125 %, due 5/15/2022	143	0,19
	90	Hymne Inc, 3,650 %, due 12/1/2027	96	0,12
	70	Hymne Inc, 4,375 %, due 12/1/2047	79	0,10
GBP	125	AT&T Inc 4,250 %, due 6/1/2043	180	0,23
	150	AT&T Inc 5,450 %, due 3/1/2047	183	0,24
	340	Bank of America Corp 3,550 %, due 3/5/2024 *	356	0,46
	140	Bank of America Corp 4,443 %, due 1/20/2048 *	172	0,22
	310	Berkshire Hathaway Inc Corp., 4,200 %, due 8/15/2048	373	0,48
	370	Boeing Co/The, 3,950 %, due 3/6/2019	419	0,54
	160	Carlyle Holdings II Finance LLC, 144A, 5,625 %, due 3/30/2043	192	0,25
	479	Celgene Corp 3,625 %, due 5/15/2024	508	0,66
	210	Charter-Kommunikation Operating LLC / Charter Kommunikation Läuft Kapital, 5,375 %, due 5/1/2047	234	0,30
	150	Cimarex Energy Co, 3,900 %, due 5/15/2027	154	0,20
	500	Citigroup Inc 8,125 %, due 7/15/2039	837	1,09
	70	Comcast Corp 4,950 %, due 10/15/2058	91	0,12
	340	CRC Health Corp 5,050 %, due 3/25/2048	397	0,52
	250	Dell International LLC/EMC Corp., 4,420 %, due 6/15/2021	258	0,34
	90	Devon Energy Corp 5,000 %, due 6/15/2045	106	0,14
EUR	180	Digital Euro Finco LLC, 2,500 %, due 1/16/2026	221	0,29
	110	Discovery Communications LLC, 4,125 %, due 5/15/2029	118	0,15
	70	Energieübertragung Betrieb LP, 6,250 %, due 4/15/2049	87	0,11
	500	Enterprise-Produkte In Betrieb LLC, 5,375 %, due 2/15/2078 *	488	0,63
	220	Exelon Corp 3,400 %, due 4/15/2026	233	0,30
	190	Treue Und Guaranty-Leben JX Holdings Inc 5,500 %, due 5/1/2025	202	0,26
	200	FirstEnergy Corp, Serie C, 7,375 %, due 11/15/2031	287	0,37
	513	GE Capital International Finanzierung Co Unlimited Co, 4,418 %, due 11/15/2035	522	0,68
GBP	200	GE Capital UK Funding Unbegrenzte Co., 8,000 %, due 1/14/2039	371	0,48
	50	General Motors Co 6,600 %, due 4/1/2036	58	0,08
	130	General Motors Co 6,750 %, due 4/1/2046	155	0,20
	16	Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	14	0,02
EUR	280	Goldman Sachs Group Inc/The, Der, 2,875 %, due 6/3/2026	360	0,47
	340	Goldman Sachs Group Inc/The, Der, 5,150 %, due 5/22/2045	413	0,54
	70	Halliburton Co 5,000 %, due 11/15/2045	78	0,10
	500	BCE Inc 5,250 %, due 6/15/2026	565	0,73
	190	BCE Inc 5,250 %, due 6/15/2049	213	0,28
	150	Humana Inc 3,125 %, due 8/15/2029	152	0,20
EUR	360	Illinois Tool Works Inc, 0,250 %, due 12/5/2024	404	0,52
	290	Intercontinental Exchange Inc., 4,250 %, due 9/21/2048	359	0,47
	450	International Lease Finance Corp., 5,875 %, due 8/15/2022	494	0,64
EUR	250	JPMorgan Chase & Co 1,090 %, due 3/11/2027 *	291	0,38
	10	Orasure Technologies Inc 4,854 %, due 4/27/2035	12	0,02
	270	Las Vegas Sands Corp, 3,500 %, due 8/18/2026	276	0,36
	210	Lehman Brothers Holding Inc, zero coupon,Perpetual †∞	-	-
	320	Lehman Brothers Holdings Escrow Des Capital Trust, zero coupon,Perpetual †∞	-	-
	130	Mars Inc., 4,200 %, due 4/1/2059	157	0,20
	230	MDC Holdings Inc 6,000 %, due 1/15/2043	237	0,31
	500	Microsoft Corp 3,700 %, due 8/8/2046	589	0,76
	200	MPLX LP, 4,800 %, due 2/15/2029	223	0,29
	340	MPLX LP, 4,500 %, due 4/15/2038	351	0,46
	250	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp, 5,000 %, due 10/15/2027	267	0,35
	112	MUFG Americas Holdings Corp., 3,000 %, due 2/10/2025	115	0,15
	190	Noble Energy Inc 3,850 %, due 1/15/2028	198	0,26
	180	Northrop Grumman Corp. 3,250 %, due 1/15/2028	191	0,25
	270	Northwest Pipeline LLC, 4,000 %, due 4/1/2027	288	0,37
	100	Nuveen LLC, 4,000 %, due 11/1/2028	113	0,15
	130	Occidental Petroleum Corp 3,400 %, due 4/15/2026	132	0,17
	120	Occidental Petroleum Corp 3,000 %, due 2/15/2027	119	0,15
	70	Occidental Petroleum Corp 4,625 %, due 6/15/2045	74	0,10
	360	Gibson Energy Inc 3,150 %, due 4/1/2022	368	0,48
EUR	250	PROLOGUEis Euro Finance LLC, 1,875 %, due 1/5/2029	313	0,41
EUR	220	PROLOGUEis Euro Finance LLC, 0,625 %, due 9/10/2031	242	0,31
	410	Umpqua Holdings Corp 4,000 %, due 12/21/2025	440	0,57
	340	Südliches Co/The, 2,950 %, due 7/1/2023	350	0,45
	310	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, due 7/1/2038	398	0,52
	150	Transkontinentale Gasleitung Line Co LLC, 7,850 %, due 2/1/2026	192	0,25
	110	UnitedHealth Group Inc 4,450 %, due 12/15/2048	134	0,17

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
EUR 290	US Bancorp 0,850 %, due 6/7/2024	334	0,43
60	Verizon Communications Inc 5,250 %, due 3/16/2037	76	0,10
300	Visa Inc., 4,300 %, due 12/14/2045	381	0,50
410	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual *	411	0,53
100	WALMART INC 4,050 %, due 6/29/2048	125	0,16
380	Wells Fargo & Co 4,600 %, due 4/1/2021 *	395	0,51
EUR 250	Wells Fargo & Co 2,250 %, due 5/2/2023	299	0,39
GBP 200	Wells Fargo & Co 4,875 %, due 11/29/2035	321	0,42
150	Western Midstream Betrieb LP, 4,650 %, due 7/1/2026	153	0,20
110	Western Midstream Betrieb LP, 4,750 %, due 8/15/2028	111	0,14
100	Western Midstream Betrieb LP, 5,500 %, due 8/15/2048	94	0,12
330	Williams Cos Inc/The 4,300 %, due 3/4/2024	352	0,46
		21.787	28,29
Sambia – 0,12 % (28. February 2019: 0,50 %)			
92	First Quantum Minerals Ltd, 7,000 %, due 2/15/2021	92	0,12
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 58.127)		60.378	78,40
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 15,45 % (28. Februar 2019 7,29 %)			
Chile – 0,47 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
EUR 310	Chilenische Regierung Internationale Anleihe, 0,830 %, due 7/2/2031	364	0,47
Kolumbien – 0,45 % (28. Februar 2019: 0,42 %)			
270	Regierung Kolumbiens Internationale Anleihe, 5,625 %, due 2/26/2044	348	0,45
Deutschland – 4,83 % (28. Februar 2019: 2,19 %)			
EUR 592	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, due 2/15/2026	712	0,93
EUR 470	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, due 2/15/2027	561	0,73
EUR 1.026	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, due 2/15/2028	1.256	1,63
EUR 430	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, due 2/15/2029	519	0,67
EUR 310	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 2007, 4,250 %, due 7/4/2039	670	0,87
		3.718	4,83
Indonesien – 0,91 % (28. Februar 2019: 1,78 %)			
650	Regierung Indonesiens Internationale Anleihe, 4,450 %, due 2/11/2024	701	0,91
Mexiko – 0,24 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
MXN 3.570	Mexican Bonos, Series M 20, 7,750 %, due 11/13/2042	184	0,24
Polen – 0,46 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
PLN 1.330	Republik Polen Staatsanleihen, Serie 0727, 2,500 %, due 7/25/2027	352	0,46
Russland – 0,70 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
RUB 11.680	Russische Bundesanleihe - OFZ, Serie 6224, 6,900 %, due 5/23/2029	174	0,23
EUR 300	Russische Auslandskinder - Eurobonds, 2,875 %, due 12/4/2025	365	0,47
		539	0,70
Großbritannien – 0,75 % (28. Februar 2019: 0,08 %)			
GBP 118	Vereinigtes Königreich Gilt, 4,750 %, due 12/7/2030	211	0,27
GBP 166	Vereinigtes Königreich Gilt, 4,500 %, due 9/7/2034	311	0,41
GBP 26	Vereinigtes Königreich Gilt, 4,500 %, due 12/7/2042	55	0,07
		577	0,75
USA – 6,64 % (28. Februar 2019: 2,40 %)			
3.910	United States Treasury Note/ Anleihe, 2,500 %, due 1/31/2024	4.090	5,31
60	United States Treasury Note/ Anleihe, 3,125 %, due 11/15/2028	69	0,09
10	United States Treasury Note/ Anleihe, 2,625 %, due 2/15/2029	11	0,01
130	United States Treasury Note/ Anleihe, 2,375 %, due 5/15/2029	140	0,18
299	United States Treasury Note/ Anleihe, 3,125 %, due 5/15/2048*	375	0,49
110	United States Treasury Note/ Anleihe, 3,375 %, due 11/15/2048	145	0,19
230	United States Treasury Note/ Anleihe, 3,000 %, due 2/15/2049	283	0,37
		5.113	6,64
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 11.404)		11.896	15,45
Investmentfonds - 4,79 % (28. Februar 2019 7,56 %)			
3.686	Western Asset Liquidity Funds PLC - Western Asset US-Dollar Fund – Klasse WA (ausschüttend)	3.686	4,79
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 3.686)		3.686	4,79
Investitionen insgesamt und Zugesagt zum beizulegenden Zeitwert bewertete Oder Verlust (Kosten USD 73.763)		76.520	99,37
Devisenterminkontrakte – 0,65 % (28. Februar 2019 0,15 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		495	0,65
Futures – 0,06 % (28. Februar 2019: 0,06 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		43	0,06
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		77.058	100,08
Credit Default Swaps – (0,84 %) (28. Februar 2019 0,44 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(646)	(0,84)
Devisenterminkontrakte – (0,07 %) (28. Februar 2019 0,18 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(52)	(0,07)
Futures – (0,14 %) (28. Februar 2019: 0,34 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(106)	(0,14)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(804)	(1,05)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verlust		76.254	99,03
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		754	0,97
Nettovermögen insgesamt	USD	77.008	100,00

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

144A Von der Registrierung befreite Wertpapiere gemäß Regel 144A von Das Securities Act von 1933 in der geänderten Fassung. Diese Wertpapiere dürfen nur weiterverkauft werden, bei Transaktionen ausgenommen Von der Registrierung bis hin zu qualifizierten institutionellen Käufern. Zum August 2019 betrugen diese Wertpapiere USD 400.000 und machten 0,52 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2019.

† Illiquide.

∞ Das Wertpapier wurde vom Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet. Ermessen des Investment Managers.

ε Für das Wertpapier besteht am 28. Februar 2019 Zahlungsausfall.

≠ Sicherheit (ganz oder teilweise) als Sicherheit zugesagt Terminhandel zum 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen
EUR – Euro
GBP – Britisches Pfund
MXN – Mexikanischer Peso
PLN – Polnischer Zloty
RUB – Russische Rubel

Analyse des Gesamtvermögens	% des Nettoinventarwerts
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,11
Investmentfonds	4,66
Derivate	0,68
Sonstige Vermögenswerte	2,55
Gesamtvermögen	100,00

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kauf/Verkauf Schutz	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)	
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1.000 %	Kauf	20.06.24	3.500	USD	(74)
Bank of America Merrill Lynch	Markit iTraxx Europe, 5,000 %	Kauf	20.06.24	3.000		(364)
Bank of America Merrill Lynch	Markit iTraxx Europe, 1,000 %	Kauf	20.06.24	4.400		(120)
Goldman Sachs	AkzoNobel NV, 1.000 %	Kauf	20.12.23	1.150		(41)
JP Morgan	Telenor ASA, 1.000 %	Kauf	20.12.23	1.150		(47)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD–)					USD	-
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (301))						(646)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (301))					USD	(646)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	278	Verkauf	USD	313		USD–	(6)
21.11.19	Citi	Kauf	USD	4.686	Verkauf	EUR	4.174			70
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	6.846	Verkauf	EUR	6.058			146
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	EUR	220	Verkauf	USD	246			(3)
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	2.895	Verkauf	EUR	2.572			50
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	4.241	Verkauf	GBP	3.503			(35)
21.11.19	Morgan Stanley	Kauf	USD	4.736	Verkauf	EUR	4.191			102
21.11.19	UBS	Kauf	USD	6.969	Verkauf	EUR	6.187			127
21.11.19	UBS	Kauf	USD	1.091	Verkauf	GBP	900			(8)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): 104 USD)										495
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (125))										(52)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (21))									USD	443

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
Euro-Bobl September 2019	(2)	USD (299)	USD	(4)
Euro-Bund December 2019	(12)	(2.325)		-
Euro-Bund September 2019	(9)	(1.772)		(60)
Euro-Buxl 30 Jahre Bond September 2019	(3)	(740)		(19)
Long Gilt December 2019	(11)	(1.797)		(6)
U.S. 10 Year Note (CBT) December 2019	(6)	(790)		(3)
U.S. 5 Year Note (CBT) December 2019	2	240		-
U.S. Long Bond (CBT) December 2019	(22)	(3.636)		(14)
U.S. Ultra Bond (CBT) December 2019	20	3.949		43
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 38)			USD	43
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (233))				(106)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (195))			USD	(63)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 83,59 % (28. Februar 2019: 87,67 %)			
Brasilien – 1,45 % (28. Februar 2019: 1,26 %)			
GBP 770	Petrobras Global Finance BV, 6,625 %, due 1/16/2034	1.010	1,45
Kanada – 0,23 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
GBP 130	Entertainment One Ltd, 4,625 %, due 7/15/2026	157	0,23
Frankreich – 8,03 % (28. Februar 2019: 8,35 %)			
940	3AB Optique Developpement SAS, 4,000 %, due 10/1/2023	974	1,40
1.038	Altice France SA/France, 5,625 %, due 5/15/2024	1.077	1,55
470	Burger King France SAS, 5,250 %, due 5/1/2023 *	477	0,69
140	Burger King France SAS, 6,000 %, due 5/1/2024	149	0,22
700	Casino Guichard Perrachon SA, 5,976 %, due 5/26/2021	707	1,02
600	Casino Guichard Perrachon SA, 1,865 %, due 6/13/2022	542	0,78
500	Casino Guichard Perrachon SA, 4,498 %, due 3/7/2024	452	0,65
240	CMA CGM SA, 7,750 %, due 1/15/2021	222	0,32
340	Europcar Mobility Group, 4,000 %, due 4/30/2026	354	0,51
670	Novafives SAS, 5,000 %, due 6/15/2025	621	0,89
		5.575	8,03
Deutschland – 11,22 % (28. Februar 2019: 10,27 %)			
500	Adler Pelzer Holding GmbH, 4,125 %, due 4/1/2024	459	0,66
1.000	ADLER Real Estate AG, 2,125 %, due 2/6/2024	1.049	1,51
680	CBR Fashion Finance BV, 5,125 %, due 10/1/2022	694	1,00
1.000	IHO Verwaltungs GmbH, 3,750 %, due 9/15/2026	1.020	1,47
665	KME SE, 6,750 %, due 2/1/2023	638	0,92
1.650	Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, due 9/30/2025	1.695	2,44
500	Novem Group GmbH, 5,250 %, due 5/15/2024 *	506	0,73
800	Platin 1426 GmbH, 5,375 %, due 6/15/2023	796	1,14
860	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH, 6,000 %, due 7/30/2026	939	1,35
		7.796	11,22
Irland – 1,11 % (28. Februar 2019: 1,96 %)			
720	James Hardie International Finance DAC, 3,625 %, due 10/1/2026	772	1,11
Israel – 1,91 % (28. Februar 2019: 1,98 %)			
1.370	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, due 10/15/2024	1.060	1,52
300	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 4,500 %, due 3/1/2025	268	0,39
		1.328	1,91
Italien – 7,67 % (28. Februar 2019: 7,01 %)			
1.000	ASR Media and Sponsorship SpA, 5,125 %, due 8/1/2024	1.050	1,51
740	International Design Group SPA, 6,500 %, due 11/15/2025	756	1,09
580	Leonardo SpA, 4,875 %, due 3/24/2025	701	1,01
140	Telecom Italia Finance SA, 7,750 %, due 1/24/2033	209	0,30
1.000	Telecom Italia SpA/Milano, 3,000 %, due 9/30/2025	1.064	1,53
1.410	Telecom Italia SpA/Milano, 3,625 %, due 5/25/2026	1.548	2,23
		5.328	7,67
Japan – 1,19 % (28. Februar 2019: 0,97 %)			
710	SoftBank Group Corp, 5,000 %, due 4/15/2028	824	1,19
Jersey – 0,22 % (28. Februar 2019: 0,20 %)			
150	LHC3 Plc, 4,125 %, due 8/15/2024	156	0,22
Luxemburg – 9,49 % (28. Februar 2019: 9,96 %)			
285	Altice Luxembourg SA, 7,250 %, due 5/15/2022	293	0,42
490	Altice Luxembourg SA, 8,000 %, due 5/15/2027	527	0,76
1.950	ARD Finance SA, 6,625 %, due 9/15/2023	2.026	2,92
1.350	Eurofins Scientific SE, 4,875 %, Perpetual *	1.446	2,08
940	Garfunkelux Holdco 3 SA, 7,500 %, due 8/1/2022	901	1,30
710	Hercule Debtco Sarl, 6,750 %, due 6/30/2024	665	0,96
720	Monitchem HoldCo 2 SA, 6,875 %, due 6/15/2022	732	1,05
		6.590	9,49
Niederlande – 6,95 % (28. Februar 2019: 4,91 %)			
720	IPD 3 BV, 4,500 %, due 7/15/2022	739	1,06
1.221	Maxeda DIY Holding BV, 6,125 %, due 7/15/2022	1.200	1,73
USD 220	OCI NV, 6,625 %, due 4/15/2023	212	0,31
760	Promontoria Holding 264 BV, 6,750 %, due 8/15/2023	690	0,99
1.000	Trivium Packaging Finance BV, 3,750 %, due 8/15/2026	1.071	1,54
840	Ziggo BV, 4,250 %, due 1/15/2027	916	1,32
		4.828	6,95
Spanien – 5,72 % (28. Februar 2019: 8,30 %)			
300	Cirsa Finance International Sarl, 6,250 %, due 12/20/2023	323	0,46
900	Codere Finance 2 Luxembourg SA, 6,750 %, due 11/1/2021	881	1,27
500	Grupo Antolin-Irausa SA, 3,250 %, due 4/30/2024	446	0,64
1.650	Lecta SA, 6,500 %, due 8/1/2023	666	0,96
690	Repsol International Finance BV, 4,500 %, due 3/25/2075 *	794	1,14
590	Tendam Brands SAU, 5,000 %, due 9/15/2024	604	0,87
260	Tendam Brands SAU, 5,250 %, due 9/15/2024 *	262	0,38
		3.976	5,72
Schweiz – 0,23 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
150	Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000 %, Perpetual *	158	0,23
Großbritannien – 16,27 % (28. Februar 2019: 16,65 %)			
GBP 520	Anglian Water Osprey Financing Plc, 5,000 %, due 4/30/2023	584	0,84
GBP 220	Co-operative Group Holdings 2011 Ltd, 7,500 %, due 7/8/2026	275	0,40
GBP 1.000	Galaxy Bidco Ltd, 6,500 %, due 7/31/2026	1.066	1,54
GBP 320	IDH Finance Plc, 6,250 %, due 8/15/2022	315	0,45
GBP 1.000	Jerrold Finco Plc, 6,125 %, due 1/15/2024	1.120	1,61
GBP 1.100	Ladbrokes Group Finance Plc, 5,125 %, due 9/8/2023	1.300	1,87
GBP 350	Marston's Issuer Plc, Serie B1, 3,320 %, due 7/15/2035 *	331	0,48
GBP 860	Mclaren Finance Plc, 5,000 %, due 8/1/2022	906	1,31
GBP 430	Miller Homes Group Holdings Plc, 5,500 %, due 10/15/2024	481	0,69
GBP 160	Pinewood Finance Co Ltd, 3,750 %, due 12/1/2023	182	0,26
GBP 910	Pinnacle Bidco Plc, 6,375 %, due 2/15/2025	1.071	1,54
GBP 670	Saga Plc, 3,375 %, due 5/12/2024	662	0,95
GBP 239	Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, due 7/13/2044	342	0,49
GBP 1.410	Virgin Media Secured Finance Plc, 5,000 %, due 4/15/2027	1.641	2,36
1.000	Viridian Group FinanceCo Plc / Viridian Power & Energy, 4,000 %, due 9/15/2025	1.030	1,48
		11.306	16,27
USA – 11,90 % (28. Februar 2019: 14,77 %)			
290	Adient Global Holdings Ltd, 3,500 %, due 8/15/2024	238	0,34
1.170	Bausch Health Cos Inc, 4,500 %, due 5/15/2023	1.189	1,71
620	Belden Inc, 4,125 %, due 10/15/2026	657	0,95
900	Cott Corp, 5,500 %, due 7/1/2024	940	1,35
1.000	Energizer Gamma Acquisition BV, 4,625 %, due 7/15/2026	1.054	1,52
700	International Game Technology Plc, 3,500 %, due 7/15/2024	765	1,10
1.000	IQVIA Inc, 3,250 %, due 3/15/2025	1.031	1,49
1.350	Kronos International Inc, 3,750 %, due 9/15/2025	1.327	1,91
1.000	LKQ European Holdings BV, 3,625 %, due 4/1/2026	1.063	1,53
		8.264	11,90
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten EUR 58.131)		58.068	83,59
Schuldscheindarlehen – 2,98 % (28. Februar 2019: 1,80 %)			
GBP 420	GVC Holdings Plc, 4,023 %, due 3/16/2024 *	466	0,67
600	TDC A/S Term Loan, 2,750 %, due 6/11/2025 *	602	0,87
1.000	Verisure Holding AB, 3,000 %, due 10/21/2022 *	999	1,44
Loan Notes insgesamt (Anschaffungskosten EUR 2.060)		2.067	2,98
Termineinlagen – 4,15 % (28. Februar 2019: 1,99 %)			
GBP 1.303	Commerzbank London, 0,530 %, due 9/3/2019	1.443	2,08
GBP 1.301	Cooperatieve Rabobank U.A, 0,600 %, due 9/3/2019	1.441	2,07
Termineinlagen insgesamt (Anschaffungskosten EUR 2.869)		2.884	4,15
Investmentfonds – 0,04 % (28. Februar 2019: 0,03 %)			
USD 32	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	29	0,04
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten EUR 27)		29	0,04
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten EUR 63.087)		63.048	90,76
Credit Default Swaps – 0,37 % (28. Februar 2019: 0,30 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		259	0,37
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		–	–
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		63.307	91,13

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nenn-wert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% des Net-toin-ventar-werts
Devisenterminkontrakte – (0,57 %) (28. Februar 2019: (0,50 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(399)	(0,57)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	(399)	(0,57)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	62.908	90,56
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	6.562	9,44
Nettovermögen insgesamt	EUR 69.470	100,00

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

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen

GBP – Britisches Pfund

USD – US-Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Nettoin-ventar-werts
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	82,98
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	2,95
Investmentfonds	0,04
Einlagen bei Kreditinstituten	4,12
Derivate	0,37
Sonstige Vermögenswerte	9,54
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kauf/Verkauf Schutz	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)	
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 5,000 %	Verkauf	20.6.2024	2.350	EUR	259
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR 227)					EUR	259
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR–)						–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR 227)					EUR	259

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertmin-derung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	10	Verkauf	EUR	10	EUR	–
21.11.19	BNP Paribas	Kauf	EUR	249	Verkauf	GBP	231		(6)
21.11.19	JP Morgan	Kauf	EUR	652	Verkauf	GBP	606		(17)
21.11.19	Royal Bank of Canada	Kauf	EUR	3.946	Verkauf	GBP	3.670		(105)
21.11.19	Societe Generale	Kauf	EUR	134	Verkauf	GBP	124		(3)
21.11.19	UBS	Kauf	EUR	10.391	Verkauf	GBP	9.657		(268)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR–)									–
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR (383))									(399)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR (383))								EUR	(399)

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Asset-Backed Securities - 2,47 % (28. Februar 2019: 2,34 %)			
138	Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Zertifikate Serie 2004-W8, Serie 2004 W8, Klasse A2, 3,105 %, due 5/25/2034 *	139	–
23.680	Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Serie 2017 2A, Klasse A, 144A, 2,970 %, due 3/20/2024	24.362	0,37
10.398	Community Funding CLO 2015-1A, Serie 2015 1A, Klasse A, 144A, 5,750 %, due 11/1/2027 †	11.031	0,17
6.371	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse A1, 144A, 2,750 %, due 7/25/2057 *	6.477	0,10
14.410	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse A2, 144A, 3,084 %, due 7/25/2057 *	14.916	0,22
8.068	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2006-I, Serie 2006 I, Klasse 2A, 2,335 %, due 1/15/2037 *	7.773	0,12
8.000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Serie 2018 4, Klasse A, 4,060 %, due 11/15/2030	8.996	0,14
10.484	Hertz Vehicle Financing II LP, Serie 2016 2A, Klasse C, 144A, 4,990 %, due 3/25/2022	10.766	0,16
28.790	Hertz Vehicle Financing II LP, Serie 2017 1A, Klasse B, 144A, 3,560 %, due 10/25/2021	29.034	0,44
11.260	Hertz Vehicle Financing II LP, Serie 2017 1A, Klasse C, 144A, 5,270 %, due 10/25/2021	11.481	0,17
24.350	Hertz Vehicle Financing II LP, Serie 2018 1A, Klasse A, 144A, 3,290 %, due 2/25/2024	25.117	0,38
5.820	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-HE1, Serie 2005 HE1, Klasse M1, 2,820 %, due 12/25/2034 *	5.744	0,09
6.784	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS, Serie 2018 2GS, Klasse A, 144A, 4,200 %, due 2/22/2044	7.091	0,11
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 157.644)		162.927	2,47
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 2,84 % (28. Februar 2019: 3,08 %)			
18.790	BBCCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Klasse D, 144A, 4,715 %, due 8/10/2033 *	19.197	0,29
10.270	CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust, Serie 2015 C3, Klasse D, 3,500 %, due 8/15/2048 *	8.459	0,13
7.000	CSAIL 2016-C7 Commercial Mortgage Trust, Serie 2016 C7, Klasse D, 144A, 4,528 %, due 11/15/2049 *	6.268	0,09
21.388	CSMC 2017-RPL3 Trust, Serie 2017 RPL3, Klasse A1, 144A, 4,000 %, due 8/1/2057 *	22.222	0,34
13.758	CSMC Serie 2009-2R, Serie 2009 2R, Klasse 1A14, 144A, 4,966 %, due 9/26/2034 *	14.156	0,21
9.912	CSMC Serie 2015-12R, Serie 2015 12R, Klasse 2A1, 144A, 2,904 %, due 11/30/2037 *	9.890	0,15
43.546	CSMC Trust 2018-J1, Serie 2018 J1, Klasse B2, 144A, 3,680 %, due 2/25/2048 *	45.086	0,68
89	Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, due 12/1/2047	93	–
3.083	Flagstar Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Klasse A4, 144A, 3,500 %, due 4/25/2048 *	3.136	0,05
8.095	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2015 DNA1, Klasse M2, 3,995 %, due 10/25/2027 *	8.160	0,12
4.091	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA1, Klasse M2, 5,166 %, due 7/25/2028 *	4.124	0,06
11.561	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 DNA1, Klasse M1, 3,345 %, due 7/25/2029 *	11.593	0,18
17.480	GS Mortgage Securities Corp II, Serie 2018 SRP5, Klasse C, 144A, 5,945 %, due 9/15/2031 *	17.502	0,27
4.700	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2014-FL6, Serie 2014 FL6, Klasse D, 144A, 6,445 %, due 11/15/2031 *	4.497	0,07
3.872	MortgageIT Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse A1, 2,745 %, due 8/25/2035 *	3.851	0,06
8.713	New Residential Mortgage Loan Trust 2017-4, Serie 2017 4A, Klasse A1, 144A, 4,000 %, due 5/25/2057 *	9.213	0,14
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 179.547)		187.447	2,84
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 32,67 % (28. Februar 2019: 34,61 %)			
Australien – 0,17 % (28. Februar 2019: 0,15 %)			
9.520	BHP Billiton Finance USA Ltd, 144A, 6,750 %, due 10/19/2075 *	11.164	0,17
Belgien – 0,68 % (28. Februar 2019: 0,98 %)			
21.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, due 1/23/2049	27.624	0,42
2.570	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,800 %, due 1/23/2059	3.510	0,05
EUR 12.000	KBC Group NV, 1,875 %, due 3/11/2027 *	13.781	0,21
		44.915	0,68
Brasilien – 0,99 % (28. Februar 2019: 0,85 %)			
11.200	Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, due 1/17/2027	13.318	0,20
27.820	Petrobras Global Finance BV, 5,999 %, due 1/27/2028	30.651	0,47
13.890	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, due 6/5/2115	15.543	0,24
5.220	Yamana Gold Inc, 4,625 %, due 12/15/2027	5.550	0,08
		65.062	0,99
Kanada – 0,18 % (28. Februar 2019: 0,16 %)			
3.060	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,250 %, due 5/15/2024	3.166	0,05
1.770	Cott Holdings Inc, 144A, 5,500 %, due 4/1/2025	1.852	0,03
6.880	Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, due 9/30/2022	6.966	0,10
		11.984	0,18
Kolumbien – 0,88 % (28. Februar 2019: 0,77 %)			
12.970	Ecopetrol SA, 5,875 %, due 9/18/2023	14.467	0,22
19.689	Ecopetrol SA, 4,125 %, due 1/16/2025	20.698	0,32
9.010	Ecopetrol SA, 5,375 %, due 6/26/2026	10.103	0,15
10.720	Ecopetrol SA, 5,875 %, due 5/28/2045	12.636	0,19
		57.904	0,88
Dänemark – 0,48 % (28. Februar 2019: 0,44 %)			
4.170	Danske Bank A/S, 144A, 5,000 %, due 1/12/2022	4.400	0,07
4.760	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, due 1/12/2024	5.252	0,08
EUR 18.920	Danske Bank A/S, 5,875 %, Perpetual *	22.134	0,33
		31.786	0,48
Frankreich – 1,91 % (28. Februar 2019: 2,09 %)			
9.553	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, due 5/1/2026	10.222	0,15
3.600	BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, due 1/10/2025 *	3.903	0,06
6.040	BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, due 1/10/2030 *	7.127	0,11
EUR 10.859	BNP Paribas SA, 6,125 %, Perpetual *	13.278	0,20
9.600	BNP Paribas SA, 144A, 7,375 %, Perpetual *	10.676	0,16
520	BNP Paribas SA, 144A, 7,625 %, Perpetual *	550	0,01
400	BNP Paribas SA, 144A, 7,000 %, Perpetual *	435	0,01
EUR 19.900	BPCE SA, 2,750 %, due 11/30/2027 *	23.752	0,36
EUR 15.857	Credit Agricole SA, 6,500 %, Perpetual *	18.865	0,29
11.610	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetual *	13.574	0,20
EUR 20.400	Societe Generale SA, 2,500 %, due 9/16/2026 *	23.541	0,36
		125.923	1,91
Indien – 0,44 % (28. Februar 2019: 0,41 %)			
INR 250.000	National Bank for Agriculture and Rural Development, Serie 16C, 8,370 %, due 6/22/2020	3.538	0,05
INR 500.000	NTPC Ltd, Serie 53, 9,170 %, due 9/22/2024	7.638	0,12
INR 500.000	Power Finance Corp Ltd, Serie 130C, 8,390 %, due 4/19/2025	7.120	0,11
INR 250.000	Power Grid Corp of India Ltd, Serie C, 8,200 %, due 1/23/2025	3.600	0,05
INR 500.000	REC Ltd, Serie 133, 8,300 %, due 4/10/2025	7.130	0,11
		29.026	0,44
Irland – 0,25 % (28. Februar 2019: 0,28 %)			
9.670	ARDAGH PACKAGING Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,625 %, due 5/15/2023	9.921	0,15
5.990	ARDAGH PACKAGING Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 6,000 %, due 2/15/2025	6.271	0,10
		16.192	0,25
Israel — 0,04 % (February 28, 2019: 0,04 %)			
3.100	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, due 12/18/2022	2.716	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^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)				
Italien – 2,22 % (28. Februar 2019: 1,36 %)				
	9.230	ENEL FINANCE International NV, 144A, 6,000 %, due 10/7/2039	11.431	0,17
	2.675	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, due 6/26/2024	2.744	0,04
	1.890	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, due 1/15/2026	1.996	0,03
EUR	25.679	Intesa Sanpaolo SpA, 7,000 %, Perpetual *	30.009	0,46
	2.210	Telecom Italia SpA/ Milano, 144A, 5,303 %, due 5/30/2024	2.373	0,04
	8.490	UniCredit SpA, 144A, 6,572 %, due 1/14/2022	9.132	0,14
	41.520	UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, due 4/2/2034 *	46.936	0,71
EUR	36.550	UniCredit SpA, 6,625 %, Perpetual *	41.792	0,63
			146.413	2,22
Luxemburg – 0,03 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
	1.550	ArcelorMittal, 7,000 %, due 10/15/2039	1.857	0,03
Macau – 0,12 % (28. Februar 2019: 0,11 %)				
	2.980	Sands China Ltd, 4,600 %, due 8/8/2023	3.178	0,05
	4.380	Sands China Ltd, 5,125 %, due 8/8/2025	4.862	0,07
			8.040	0,12
Mexiko – 0,42 % (28. Februar 2019: 0,43 %)				
	3.900	BANCO MERCANTIL DEL Norte SA/Grand Cayman, 144A, 6,875 %, Perpetual *	3.876	0,06
	8.900	BANCO MERCANTIL DEL Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, Perpetual *	8.936	0,14
	15.780	Petroleos Mexicanos, 6,375 %, due 1/23/2045	14.596	0,22
			27.408	0,42
Niederlande – 1,33 % (28. Februar 2019: 1,33 %)				
EUR	20.400	ABN AMRO Bank NV, 5,750 %, Perpetual *	23.435	0,36
EUR	33.200	Cooperatieve Rabobank UA, 6,625 %, Perpetual *	40.157	0,61
EUR	20.000	ING Groep NV, 2,500 %, due 2/15/2029 *	23.934	0,36
			87.526	1,33
Südafrika – 0,29 % (28. Februar 2019: 0,25 %)				
	3.290	Anglo American Capital Plc, 144A, 3,625 %, due 9/11/2024	3.397	0,05
	1.400	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,000 %, due 9/11/2027	1.445	0,02
	3.950	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,500 %, due 3/15/2028	4.202	0,06
	8.930	Myriad International Holdings BV, 144A, 4,850 %, due 7/6/2027	10.159	0,16
			19.203	0,29
Spanien – 0,94 % (28. Februar 2019: 1,49 %)				
EUR	32.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 8,875 %, Perpetual *	39.126	0,59
EUR	19.800	Banco Santander SA, 6,250 %, Perpetual *	22.903	0,35
			62.029	0,94
Supranational – 0,19 % (28. Februar 2019: 0,18 %)				
IDR	175.900.000	International Bank for Reconstruction & Development, 8,400 %, due 10/12/2021	12.759	0,19
Schweiz – 1,28 % (28. Februar 2019: 1,14 %)				
	720	Credit Suisse Group AG, 144A, 3,869 %, due 1/12/2029 *	767	0,01
	770	Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, Perpetual *	820	0,01
	8.680	Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, Perpetual *	9.251	0,14
	510	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd, 4,550 %, due 4/17/2026	566	0,01
	13.940	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd, 4,875 %, due 5/15/2045	17.663	0,27
	210	Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, due 3/12/2024	221	–
	6.810	Glencore Funding LLC, 144A, 3,875 %, due 10/27/2027	7.003	0,11
EUR	9.400	UBS Group Funding Switzerland AG, 5,750 %, Perpetual *	11.336	0,17
	11.160	UBS Group Funding Switzerland AG, 6,875 %, Perpetual *	11.937	0,18
	7.050	UBS Group Funding Switzerland AG, 7,000 %, Perpetual *	7.735	0,12
	15.800	UBS Group Funding Switzerland AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	16.768	0,26
			84.067	1,28
Vereinigte Arabische Emirate - 0,01 % (February 28, 2019: 0,03 %)				
	770	DAE Funding LLC, 144A, 5,750 %, due 11/15/2023	814	0,01
Großbritannien – 3,38 % (28. Februar 2019: 3,72 %)				
	2.410	Barclays Bank Plc, 7,625 %, due 11/21/2022	2.659	0,04
	13.340	Barclays Plc, 4,972 %, due 5/16/2029 *	14.650	0,22
	340	Barclays Plc, 5,088 %, due 6/20/2030 *	353	0,01
EUR	19.300	Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual *	22.697	0,35
	9.260	Barclays Plc, 7,750 %, Perpetual *	9.463	0,14
	14.720	Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual *	15.320	0,23
	17.360	BAT Capital Corp, 3,557 %, due 8/15/2027	17.802	0,27
	10.340	BAT Capital Corp, 4,540 %, due 8/15/2047	10.386	0,16
	10.750	HSBC Holdings Plc, 4,583 %, due 6/19/2029 *	12.025	0,18
	22.005	HSBC Holdings Plc, 6,500 %, Perpetual *	22.634	0,34
	3.280	Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, Perpetual *	3.399	0,05
	900	Reynolds American Inc, 6,150 %, due 9/15/2043	1.067	0,02
	7.942	Royal Bank of Scotland Group Plc, 6,125 %, due 12/15/2022	8.597	0,13
	3.280	Royal Bank of Scotland Group Plc, 6,100 %, due 6/10/2023	3.559	0,05
	6.410	Royal Bank of Scotland Group Plc, 6,000 %, due 12/19/2023	6.985	0,11
	57.370	Royal Bank of Scotland Group Plc, 5,125 %, due 5/28/2024	60.756	0,92
	6.970	Royal Bank of Scotland Group Plc, 8,625 %, Perpetual *	7.397	0,11
	1.560	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,250 %, due 1/15/2026	1.605	0,03
	1.530	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, due 5/15/2029	1.603	0,02
			222.957	3,38
USA – 16,35 % (28. Februar 2019: 18,31 %)				
	2.380	Ally Financial Inc, 8,000 %, due 11/1/2031	3.338	0,05
	2.320	Altria Group Inc, 4,400 %, due 2/14/2026	2.545	0,04
	8.030	Altria Group Inc, 4,800 %, due 2/14/2029	9.083	0,14
	4.244	Altria Group Inc, 6,200 %, due 2/14/2059	5.465	0,08
	2.540	Amazon.com Inc, 4,950 %, due 12/5/2044	3.411	0,05
	29.830	Amazon.com Inc, 4,050 %, due 8/22/2047	36.647	0,56
	43.400	Amazon.com Inc, 4,250 %, due 8/22/2057	55.348	0,84
	3.890	Anadarko Petroleum Corp, 5,550 %, due 3/15/2026	4.408	0,07
	5.320	Anadarko Petroleum Corp, 6,200 %, due 3/15/2040	6.539	0,10
	4.135	Anadarko Petroleum Corp, 4,500 %, due 7/15/2044	4.263	0,06
	7.820	Anadarko Petroleum Corp, 6,600 %, due 3/15/2046	10.360	0,16
	20.816	Apache Corp, 5,100 %, due 9/1/2040	21.091	0,32
	5.810	Apache Corp, 4,750 %, due 4/15/2043	5.626	0,09
	13.050	Apache Corp, 4,250 %, due 1/15/2044	11.863	0,18
	4.410	Arconic Inc, 5,870 %, due 2/23/2022	4.711	0,07
	23.560	BAC Capital Trust XIV, Serie G, 4,000 %, Perpetual *	20.598	0,31
	20.180	Bank of America Corp, Serie X, 6,250 %, Perpetual *	22.011	0,33
	31.390	Bank of America Corp, Serie AA, 6,100 %, Perpetual *	34.238	0,52
	29.340	Bank of America Corp, Serie FF, 5,875 %, Perpetual *	31.925	0,48
	34.410	Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, due 3/15/2024	36.428	0,55
	2.490	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, due 11/1/2025	2.621	0,04
	7.010	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,125 %, due 11/15/2022	7.080	0,11
	3.470	Boeing Co/The, 2,700 %, due 2/1/2027	3.568	0,05
	8.470	Boeing Co/The, 3,250 %, due 2/1/2035	9.011	0,14
	2.700	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,375 %, due 5/1/2025	2.811	0,04
	1.670	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,000 %, due 2/1/2028	1.758	0,03
	1.050	Centene Corp, 4,750 %, due 5/15/2022	1.080	0,02
	1.620	Centene Corp, 6,125 %, due 2/15/2024	1.700	0,03
	2.590	Centene Corp, 4,750 %, due 1/15/2025	2.694	0,04
	15.380	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, due 3/15/2028	16.379	0,25
	5.740	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, due 4/1/2038	6.483	0,10

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
10.730	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,834 %, due 10/23/2055	13.697	0,21
1.780	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 5,125 %, due 6/30/2027	1.971	0,03
150	Cimarex Energy Co, 3,900 %, due 5/15/2027	154	–
6.095	Citigroup Inc, 8,125 %, due 7/15/2039	10.199	0,15
4.834	Citigroup Inc, 5,300 %, due 5/6/2044	6.178	0,09
57.255	Citigroup Inc, Serie P, 5,950 %, Perpetual *	61.312	0,93
8.789	CommonSpirit Health, 4,350 %, due 11/1/2042	9.594	0,15
2.890	CommonSpirit Health, 3,817 %, due 10/1/2049	3.015	0,05
1.530	CommScope Technologies LLC, 144A, 5,000 %, due 3/15/2027	1.287	0,02
6.107	Concho Resources Inc, 4,850 %, due 8/15/2048	7.105	0,11
370	Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, due 1/15/2028	380	0,01
8.260	Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, due 6/1/2044	8.329	0,13
5.110	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, due 2/1/2029	5.736	0,09
1.400	CVS Health Corp, 4,780 %, due 3/25/2038	1.569	0,02
31.930	CVS Health Corp, 5,050 %, due 3/25/2048	37.248	0,57
305	DaVita Inc, 5,000 %, due 5/1/2025	307	–
4.540	DCP MIDSTREAM Operating LP, 144A, 6,750 %, due 9/15/2037	4.790	0,07
11.660	Devon Energy Corp, 5,850 %, due 12/15/2025	13.975	0,21
180	Devon Energy Corp, 5,600 %, due 7/15/2041	222	–
160	Devon Energy Corp, 4,750 %, due 5/15/2042	178	–
2.370	Devon Energy Corp, 5,000 %, due 6/15/2045	2.790	0,04
3.720	Dignity Health, 5,267 %, due 11/1/2064	4.719	0,07
5.650	DISH DBS Corp, 5,875 %, due 11/15/2024	5.396	0,08
190	DISH DBS Corp, 7,750 %, due 7/1/2026	187	–
4.680	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, due 2/15/2078 *	4.567	0,07
30.515	FirstEnergy Corp, Serie C, 7,375 %, due 11/15/2031	43.772	0,66
2.950	FirstEnergy Corp, Serie C, 4,850 %, due 7/15/2047	3.612	0,05
4.060	Fox Corp, 144A, 4,709 %, due 1/25/2029	4.703	0,07
3.700	Fox Corp, 144A, 5,476 %, due 1/25/2039	4.639	0,07
70	Freeport-McMoRan Inc, 3,875 %, due 3/15/2023	71	–
250	Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, due 11/14/2024	253	–
5.370	GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418 %, due 11/15/2035	5.469	0,08
5.483	General Electric Co, 5,875 %, due 1/14/2038	6.340	0,10
11.060	General Electric Co, 6,875 %, due 1/10/2039	14.112	0,21
4.730	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 6,750 %, due 8/1/2022	4.799	0,07
915	Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	776	0,01
655	Goldman Sachs Capital III, Serie APEX, 4,000 %, Perpetual *	528	0,01
12.340	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, due 10/1/2037	16.924	0,26
16.590	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, due 5/22/2045	20.159	0,31
3.280	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, due 10/21/2045	4.059	0,06
5.990	Hackensack Meridian Health Inc, 4,211 %, due 7/1/2048	7.343	0,11
2.370	HCA Inc, 7,690 %, due 6/15/2025	2.850	0,04
260	HCA Inc, 5,625 %, due 9/1/2028	296	–
5.130	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875 %, due 4/1/2027	5.419	0,08
6.290	ILFC E-Capital Trust I, 144A, 4,090 %, due 12/21/2065 *	4.413	0,07
3.720	INTERNATIONAL LEASE Finance Corp, 5,875 %, due 8/15/2022	4.087	0,06
6.040	Kerr-McGee Corp, 6,950 %, due 7/1/2024	7.147	0,11
2.330	Kinder Morgan Inc/DE, 5,300 %, due 12/1/2034	2.717	0,04
GBP 6.619	Kraft Heinz Foods Co, 4,125 %, due 7/1/2027	8.880	0,13
1.550	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,875 %, due 11/1/2026	1.626	0,02
10.060	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, due 8/8/2024	10.276	0,16
1.260	Level 3 Financing Inc, 6,125 %, due 1/15/2021	1.269	0,02
3.930	MPLX LP, 4,800 %, due 2/15/2029	4.374	0,07
7.720	MPLX LP, 5,200 %, due 3/1/2047	8.418	0,13
4.580	MPLX LP, 4,700 %, due 4/15/2048	4.722	0,07
7.030	MPLX LP, 5,500 %, due 2/15/2049	8.067	0,12
4.060	Noble Energy Inc, 3,850 %, due 1/15/2028	4.238	0,06
3.790	Occidental Petroleum Corp, 2,900 %, due 8/15/2024	3.828	0,06
3.960	Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, due 8/15/2026	4.006	0,06
2.570	Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, due 6/15/2045	2.718	0,04
660	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, due 4/15/2046	675	0,01
1.400	Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, due 2/15/2047	1.392	0,02
3.140	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, due 3/15/2048	3.173	0,05
2.325	PulteGroup Inc, 6,375 %, due 5/15/2033	2.540	0,04
2.220	Range Resources Corp, 5,875 %, due 7/1/2022	2.137	0,03
4.760	Range Resources Corp, 4,875 %, due 5/15/2025	3.927	0,06
6.910	Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, due 4/15/2040	7.676	0,12
2.740	Sprint Capital Corp, 8,750 %, due 3/15/2032	3.439	0,05
2.220	Sprint Communications Inc, 11,500 %, due 11/15/2021	2.614	0,04
660	Sprint Corp, 7,875 %, due 9/15/2023	744	0,01
310	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,375 %, due 2/1/2027	321	0,01
1.730	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900 %, due 9/15/2044	2.180	0,03
1.300	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, due 7/1/2038	1.669	0,03
10.190	Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, zero coupon, due 2/15/2024	8.345	0,13
2.100	Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, zero coupon, due 2/15/2038	838	0,01
9.580	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, due 2/1/2026	12.271	0,19
2.000	United Rentals North America Inc, 4,625 %, due 7/15/2023	2.051	0,03
920	United Rentals North America Inc, 5,875 %, due 9/15/2026	990	0,02
3.040	United Rentals North America Inc, 6,500 %, due 12/15/2026	3.317	0,05
3.340	United Rentals North America Inc, 5,250 %, due 1/15/2030	3.582	0,05
105.779	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual *	105.940	1,61
7.400	Wells Fargo & Co, 4,650 %, due 11/4/2044	8.900	0,14
5.420	Wells Fargo & Co, 4,400 %, due 6/14/2046	6.301	0,10
2.930	Wells Fargo & Co, 4,750 %, due 12/7/2046	3.595	0,05
3.926	Wells Fargo & Co, Serie U, 5,875 %, Perpetual *	4.333	0,07
3.490	Wesleyan University, 4,781 %, due 7/1/2116	4.435	0,07
4.630	Western Midstream Operating LP, 3,950 %, due 6/1/2025	4.595	0,07
765	Western Midstream Operating LP, 4,650 %, due 7/1/2026	780	0,01
5.832	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, due 4/1/2044	5.426	0,08
3.010	William Lyon Homes Inc, 5,875 %, due 1/31/2025	3.055	0,05
7.350	Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, due 1/15/2031	9.792	0,15
5.400	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, due 3/15/2032	7.881	0,12
3.980	Willis-Knighton Medical Center, Serie 2018, 4,813 %, due 9/1/2048	5.160	0,08
6.980	WPX Energy Inc, 8,250 %, due 8/1/2023	7.800	0,12
11.033	XPO CNW Inc, 6,700 %, due 5/1/2034	10.867	0,16
8.202	XPO Logistics Inc, 144A, 6,500 %, due 6/15/2022	8.402	0,13
		1.078.041	16,35
Sambia – 0,09 % (28. February 2019: 0,09 %)			
1.510	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, due 4/1/2023	1.427	0,02
5.000	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, due 4/1/2025	4.600	0,07
		6.027	0,09
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 2.002.958)		2.153.813	32,67

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 50,61 % (28. Februar 2019: 47,31 %)			
Argentinien – 1,30 % (28. Februar 2019: 3,31 %)			
ARS 176.250	Argentina Bonar Bonds, 54,553 %, due 4/3/2022 *	1.266	0,02
ARS 784.240	Argentina POM Politica Monetaria, Serie POM, 66,777 %, due 6/21/2020 *	4.483	0,07
ARS 333.790	Argentina Treasury Bill, zero coupon, due 7/29/2020	3.722	0,06
ARS 315.695	Argentina Treasury Bill, zero coupon, fällig 10/29/2020	2.652	0,04
ARS 423.768	Argentine Bonos del Tesoro, 18,200 %, due 10/3/2021	2.129	0,03
ARS 390.490	Argentine Bonos del Tesoro, 16,000 %, due 10/17/2023	2.062	0,03
ARS 353.410	Argentine Bonos del Tesoro, 15,500 %, due 10/17/2026	1.877	0,03
33.490	Argentine Republic Government International Bond, 5,625 %, due 1/26/2022	13.396	0,20
16.960	Argentine Republic Government International Bond, 7,500 %, due 4/22/2026	6.636	0,10
35.450	Argentine Republic Government International Bond, 5,875 %, due 1/11/2028	13.471	0,20
5.970	Argentine Republic Government International Bond, 7,625 %, due 4/22/2046	2.328	0,04
38.100	Argentine Republic Government International Bond, 7,125 %, due 6/28/2117	14.764	0,22
ARS 1.105.490	Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER, 4,000 %, due 3/6/2020 β	13.787	0,21
9.990	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 7,875 %, due 6/15/2027	3.347	0,05
		85.920	1,30
Australien – 0,62 % (28. Februar 2019: 0,49 %)			
AUD 45.080	Australia Government Bond, Serie 150, 3,000 %, due 3/21/2047	40.843	0,62
Brasilien – 5,04 % (28. Februar 2019: 4,68 %)			
BRL 22.436	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie B, Serie NTNB, 6,000 %, due 8/15/2050 β	24.184	0,37
BRL 466.925	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2021	118.812	1,80
BRL 276.118	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2023	73.129	1,11
BRL 48.251	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, due 1/1/2027	13.363	0,20
8.530	Brazilian Government International Bond, 4,250 %, due 1/7/2025	9.093	0,14
87.840	Brazilian Government International Bond, 5,000 %, due 1/27/2045	93.605	1,42
		332.186	5,04
China – 0,41 % (28. Februar 2019: 0,73 %)			
CNY 54.500	China Government Bond, 3,380 %, due 11/21/2024	7.780	0,12
CNY 121.000	China Government Bond, 3,480 %, due 6/29/2027	17.582	0,27
CNY 11.000	China Government Bond, 3,600 %, due 6/27/2028	1.613	0,02
		26.975	0,41
Kolumbien – 0,68 % (28. Februar 2019: 0,92 %)			
34.760	Colombia Government International Bond, 5,625 %, due 2/26/2044	44.841	0,68
Ecuador – 0,56 % (28. Februar 2019: 0,60 %)			
11.720	Ecuador Government International Bond, 7,950 %, due 6/20/2024	11.837	0,18
8.300	Ecuador Government International Bond, 144A, 9,650 %, due 12/13/2026	8.612	0,13
16.800	Ecuador Government International Bond, 144A, 8,875 %, due 10/23/2027	16.653	0,25
		37.102	0,56
Ägypten – 1,32 % (28. Februar 2019: 0,71 %)			
EGP 434.920	Egypt Government Bond, 15,160 %, due 10/10/2022	26.477	0,40
EGP 22.000	Egypt Government Bond, Serie 7YR, 18,400 %, due 5/30/2024	1.513	0,02
EGP 151.010	Egypt Government Bond, Serie 10YR, 15,250 %, due 12/9/2024	9.465	0,15
11.630	Egypt Government International Bond, 144A, 5,577 %, due 2/21/2023	12.017	0,18
EGP 268.300	Egypt Treasury Bills, Serie 273D, zero coupon, due 12/3/2019	15.691	0,24
EGP 268.400	Egypt Treasury Bills, Serie 273D, zero coupon, due 3/10/2020	15.053	0,23
EGP 13.000	Egypt Treasury Bills, Serie 273D, zero coupon, due 3/24/2020	720	0,01
EGP 107.325	Egypt Treasury Bills, zero coupon, due 5/26/2020	5.843	0,09
		86.779	1,32
Ghana – 0,36 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
2.180	Ghana Government International Bond, 144A, 7,875 %, due 3/26/2027	2.244	0,03
17.200	Ghana Government International Bond, 144A, 8,125 %, due 3/26/2032	16.865	0,26
4.780	Ghana Government International Bond, 144A, 8,950 %, due 3/26/2051	4.714	0,07
		23.823	0,36
Indien – 2,11 % (28. Februar 2019: 1,83 %)			
INR 300.000	Export-Import Bank of India, Serie P-03, 9,300 %, due 5/11/2022	4.452	0,07
INR 1.510.000	India Government Bond, 8,120 %, due 12/10/2020	21.749	0,33
INR 1.550.000	India Government Bond, 7,800 %, due 4/11/2021	22.340	0,34
INR 1.580.000	India Government Bond, Serie SPB, 8,130 %, due 9/21/2022	23.370	0,35
INR 500.000	India Government Bond, 7,160 %, due 5/20/2023	7.222	0,11
INR 1.200.000	India Government Bond, 8,830 %, due 11/25/2023	18.349	0,28
INR 1.480.000	India Government Bond, 8,150 %, due 11/24/2026	22.338	0,34
INR 1.300.000	India Government Bond, 7,590 %, due 3/20/2029	19.199	0,29
		139.019	2,11
Indonesien – 5,62 % (28. Februar 2019: 2,09 %)			
12.100	Indonesia Government International Bond, 4,350 %, due 1/11/2048	13.783	0,21
IDR 79.981.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR61, 7,000 %, due 5/15/2022	5.719	0,09
IDR 18.941.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR56, 8,375 %, due 9/15/2026	1.419	0,02
IDR 1.324.546.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR59, 7,000 %, due 5/15/2027	92.027	1,40
IDR 547.847.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR71, 9,000 %, due 3/15/2029	42.445	0,64
IDR 1.579.922.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR78, 8,250 %, due 5/15/2029	118.842	1,80
IDR 1.286.832.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR68, 8,375 %, due 3/15/2034	95.925	1,46
		370.160	5,62
Japan – 2,59 % (28. Februar 2019: 2,27 %)			
JPY 3.540.000	Japan Government Thirty Year Bond, Serie 59, 0,700 %, due 6/20/2048	38.690	0,59
JPY 4.980.000	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 18, 0,100 %, due 3/10/2024 β	49.871	0,76
JPY 2.650.000	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 20, 0,100 %, due 3/10/2025 β	26.054	0,39
JPY 5.689.800	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100 %, due 3/10/2026 β	56.243	0,85
		170.858	2,59
Mexiko – 6,87 % (28. Februar 2019: 5,91 %)			
MXN 175.110	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, due 11/23/2034	9.138	0,14
MXN 6.933.344	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, due 11/13/2042	356.933	5,41
MXN 1.643.320	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, due 11/7/2047	86.969	1,32
		453.040	6,87
Russland – 9,06 % (28. Februar 2019: 4,30 %)			
RUB 238.560	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6220, 7,400 %, due 12/7/2022	3.657	0,06
RUB 1.043.860	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6219, 7,750 %, due 9/16/2026	16.407	0,25
RUB 1.043.840	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6226, 7,950 %, due 10/7/2026	16.625	0,25
RUB 10.803.401	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6207, 8,150 %, due 2/3/2027	173.496	2,63
RUB 10.542.282	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, due 1/19/2028	159.452	2,42
RUB 7.704.400	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, due 5/23/2029	114.741	1,74
RUB 1.357.010	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6228, 7,650 %, due 4/10/2030	21.240	0,32
RUB 514.670	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6221, 7,700 %, due 3/23/2033	8.053	0,12
RUB 4.175.000	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6225, 7,250 %, due 5/10/2034	62.869	0,95
RUB 1.325.380	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6230, 7,700 %, due 3/16/2039	20.876	0,32
		597.416	9,06
Südafrika – 3,37 % (28. Februar 2019: 3,71 %)			
ZAR 524.480	Republic of South Africa Government Bond, Serie R186, 10,500 %, due 12/21/2026	38.853	0,59

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Südafrika – (Fortsetzung)			
ZAR 846.895	Republic of South Africa Government Bond, Serie R213, 7,000 %, due 2/28/2031	47.404	0,72
ZAR 1.994.850	Republic of South Africa Government Bond, Serie R209, 6,250 %, due 3/31/2036	95.304	1,45
ZAR 106.880	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500 %, due 2/28/2041	4.953	0,08
35.340	Republic of South Africa Government International Bond, 4,300 %, due 10/12/2028	35.259	0,53
		221.773	3,37
Türkei – 1,03 % (28. Februar 2019: 1,32 %)			
71.510	Turkey Government International Bond, 6,125 %, due 10/24/2028	67.593	1,03
Vereinigte Arabische Emirate - 0,34 % (February 28, 2019: 1,06 %)			
18.180	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 4,125 %, due 10/11/2047	22.650	0,34
USA – 9,33 % (28. Februar 2019: 12,21 %)			
5.430	City of Chicago IL, 6,314 %, due 1/1/2044	6.191	0,10
4.240	City of Detroit MI, 4,000 %, due 4/1/2044	3.904	0,06
1.820	Morongo Band of Mission Indians/The, 144A, 7,000 %, due 10/1/2039	2.138	0,03
4.675	New Jersey Transportation Trust Fund Authority, 6,561 %, due 12/15/2040	6.729	0,10
16.650	State of Illinois, 5,100 %, due 6/1/2033	18.134	0,28
10.420	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,750 %, due 2/15/2045 β	12.420	0,19
32.180	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, due 2/15/2046 β	40.434	0,61
215.190	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, due 2/15/2049 β	259.639	3,94
14.350	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, due 7/31/2026	14.744	0,22
250.980	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, due 8/31/2026	249.642	3,79
760	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, due 8/15/2029	768	0,01
		614.743	9,33
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 3.646.021)		3.335.721	50,61
Schuldscheindarlehen – 2,40 % (28. Februar 2019: 2,19 %)			
6.057	1011778 BC ULC, 4,484 %, due 2/16/2024 *	6.058	0,09
2.548	Albertson's LLC, 5,234 %, due 8/7/2026 *	2.560	0,04
1.144	Aramark Services Inc, 4,080 %, due 3/11/2025 *	1.145	0,02
2.853	Asurion LLC, 5,234 %, due 11/3/2024 *	2.858	0,04
2.832	Avolon TLB Borrower 1 U.S. LLC, 4,021 %, due 1/15/2025 *	2.842	0,05
5.156	Berry Global Inc, 4,451 %, due 10/1/2022 *	5.164	0,08
1.579	Berry Global Inc, 4,451 %, due 1/19/2024 *	1.581	0,02
6.427	Caesars Resort Collection LLC, 4,984 %, due 12/22/2024 *	6.342	0,10
2.880	CBS Radio Inc, 4,991 %, due 11/17/2024 *	2.882	0,04
2.536	CenturyLink Inc, 4,984 %, due 1/31/2025 *	2.505	0,04
5.644	CHANGE HEALTHCARE Holdings LLC, 4,734 %, due 3/1/2024 *	5.582	0,08
6.289	Charter Communications Operating LLC, 4,330 %, due 4/30/2025 *	6.311	0,10
3.990	CityCenter Holdings LLC, 4,484 %, due 4/18/2024 *	3.995	0,06
4.451	Dell International LLC, 4,240 %, due 9/7/2023 *	4.466	0,07
2.244	DigiCert Holdings Inc, 6,234 %, due 10/31/2024 *	2.247	0,03
1.786	Edelman Financial Center LLC/The, 5,432 %, due 7/19/2025 *	1.787	0,03
2.412	Golden Nugget Inc, 4,932 %, due 10/4/2023 *	2.415	0,04
2.493	Hilton Worldwide Finance LLC, 4,016 %, due 6/21/2026 *	2.503	0,04
1.340	Intelsat Jackson Holdings S.A., 5,991 %, due 11/27/2023 *	1.342	0,02
1.476	Intrawest Resorts Holdings Inc, 5,234 %, due 7/31/2024 *	1.475	0,02
7.618	Jaguar Holding Co II, 4,734 %, due 8/18/2022 *	7.590	0,11
1.666	Jane Street Group LLC, 5,234 %, due 8/25/2022 *	1.661	0,02
6.235	Level 3 Financing Inc, 4,484 %, due 2/22/2024 *	6.248	0,09
5.361	MGM Growth Properties Operating Partnership, 4,234 %, due 3/19/2025 *	5.372	0,08
1.205	Michaels Stores Inc, 4,769 %, due 1/28/2023 *	1.145	0,02
5.399	MPH Acquisition Holdings LLC, 5,080 %, due 6/7/2023 *	5.034	0,08
1.370	Phoenix Guarantor Inc, 6,744 %, due 3/5/2026 *	1.365	0,02
4.724	Post Holdings Inc, 4,270 %, due 5/24/2024 *	4.732	0,07
6.509	Prime Security Services Borrower LLC, 4,984 %, due 5/2/2022 *	6.514	0,10
4.999	RegionalCare Hospital Partners Holding, 6,769 %, due 11/16/2025 *	4.969	0,08
8.305	Reynolds Group Holdings Inc, 4,984 %, due 2/5/2023 *	8.310	0,13
1.467	RPI Finance Trust, 4,234 %, due 4/17/2023 *	1.472	0,02
770	Scientific Games International Inc, 4,984 %, due 8/14/2024 *	762	0,01
8.470	Scientific Games International Inc, 4,984 %, due 8/14/2024 *	8.385	0,13
4.224	Securus Technologies Holdings LLC, 6,830 %, due 11/1/2024 *	3.804	0,06
4.844	SFR Group SA, 5,883 %, due 1/6/2026 *	4.771	0,07
4.818	TKC Holdings Inc, 5,990 %, due 2/1/2023 *	4.715	0,07
2.722	Trans Union LLC, 4,234 %, due 4/9/2023 *	2.729	0,04
8.700	Univision Communications Inc, 4,984 %, due 3/15/2024 *	8.338	0,13
1.510	Valeant Pharmaceuticals International, 5,201 %, due 5/28/2025 *	1.514	0,02
1.550	Virgin Media Bristol LLC, 4,695 %, due 1/31/2026 *	1.551	0,02
1.187	VVC Holding Corp, 6,701 %, due 2/11/2026 *	1.183	0,02
Loan Notes insgesamt (Anschaffungskosten USD 160.027)		158.224	2,40
Investmentfonds - 0,39 % (28. Februar 2019: 0,85 %)			
2.103	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse M	25.574	0,39
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 26.332)		25.574	0,39
Vorzugsaktien – 0,09 % (28. Februar 2019: 0,08 %)			
USA – 0,09 % (28. Februar 2019: 0,08 %)			
214	GMAC Capital Trust I, Serie 2	5.617	0,09
Vorzugsaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 5.592)		5.617	0,09
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 6.178.121)		6.029.323	91,47

Kontrakte (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Gekaufte Optionen – 0,12 % (28. Februar 2019: 0,27 %)			
–	Australian Dollar Currency Future October 2019 Call 68,50, due 10/4/2019	32	–
–	Australian Dollar Currency Future September 2019 Call 68,50, due 9/6/2019	6	–
–	Euro Currency Future October 2019 Call 1,1250, due 10/4/2019	34	–
–	Euro Currency Future September 2019 Call 1,13, due 9/6/2019	1	–
EUR 12	Euro-Bund October 2019 Call 183,00, due 9/20/2019	126	–
EUR 22	Euro-Bund October 2019 Call 183,50, due 9/20/2019	236	–
EUR 2	Euro-Bund October 2019 Put 175,00, due 9/20/2019	760	0,01
9	U.S. 10 Year October 2019 Call 138,00, due 9/20/2019	–	–
2	U.S. 10 Year October 2019 Call 139,00, due 9/20/2019	–	–
7	U.S. 10 Year October 2019 Put 123,50, due 9/20/2019	–	–
7	U.S. 10 Year October 2019 Put 124,00, due 9/20/2019	–	–
2	U.S. 10 Year October 2019 Put 124,50, due 9/20/2019	–	–
20	U.S. 10 Year October 2019 Put 127,50, due 9/20/2019	–	–
10	U.S. 10 Year October 2019 Put 128,00, due 9/20/2019	–	–
1	U.S. 10 Year October 2019 Put 131,25, due 9/20/2019	456	0,01
1	U.S. 10 Year October 2019 Put 131,50, due 9/20/2019	419	0,01
1	U.S. 5 Year October 2019 Call 124,50, due 9/20/2019	–	–
–	U.S. 5 Year October 2019 Call 124,75, due 9/20/2019	–	–
4	U.S. 5 Year October 2019 Put 115,00, due 9/20/2019	–	–
13	U.S. 5 Year October 2019 Put 115,50, due 9/20/2019	–	–
3	U.S. Bond October 2019 Call 179,00, due 9/20/2019	52	–
–	U.S. Bond October 2019 Put 161,00, due 9/20/2019	77	–
67.240	USD Call/EUR Put 1,1301, due 10/22/2019	1.772	0,03
74.500	USD Call/EUR Put 1,1450, due 10/22/2019	2.832	0,04
66.600	USD Put/BRL Call 3,95, due 11/27/2019	434	0,01
432.700	USD Put/INR Call 62,50, due 5/14/2020	32	–
70.010	USD Put/INR Call 68,70, due 10/15/2019	11	–
104.490	USD Put/INR Call 69,42, due 9/26/2019	13	–

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Kontrakte (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Gekaufte Optionen – (Fortsetzung)			
77.410	USD Put/INR Call 71,50, due 9/6/2019	113	–
104.920	USD Put/MXN Call 19,1468, due 9/26/2019	46	–
67.360	USD Put/RUB Call 65,2772, due 11/21/2019	408	0,01
67.830	USD Put/RUB Call 65,50, due 11/4/2019	384	–
Gekaufte Optionen insgesamt (Anschaffungskosten USD 14.297)		8.244	0,12
Credit Default Swaps – 0,62 % (28. Februar 2019: 0,97 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		40.886	0,62
Zinsswaps – (2,41 %) (28. Februar 2019: 2,29 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		159.010	2,41
Swaptions – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		110	–
Devisenterminkontrakte – 1,34 % (28. Februar 2019: 1,12 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		88.363	1,34
Futures – 1,62 % (28. Februar 2019: 1,93 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		106.607	1,62
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		6.432.543	97,58

Kontrakte (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Verkaufte Optionen – (1,18 %) (28. Februar 2019: 0,16 %)			
	(1) Euro Currency Future November 2019 Put 1,11, due 11/8/2019	(909)	(0,01)
	– Euro Currency Future November 2019 Put 1,1150, due 11/8/2019	(548)	(0,01)
	(1) Euro Currency Future October 2019 Put 1,1150, due 10/4/2019	(845)	(0,01)
EUR	(1) Euro-Bund November 2019 Call 178,00, due 10/25/2019	(303)	(0,01)
EUR	– Euro-Bund November 2019 Put 173,00, due 10/25/2019	(22)	–
EUR	– Euro-Bund November 2019 Put 174,00, due 10/25/2019	(136)	–
EUR	– Euro-Bund October 2019 Call 173,00, due 9/20/2019	(1.445)	(0,02)
EUR	(1) Euro-Bund October 2019 Call 176,00, due 9/20/2019	(560)	(0,01)
EUR	(1) Euro-Bund October 2019 Call 177,00, due 9/20/2019	(425)	(0,01)
EUR	– Euro-Bund October 2019 Put 170,00, due 9/20/2019	(1)	–
EUR	(1) Euro-Bund October 2019 Put 171,50, due 9/20/2019	(17)	–
EUR	– Euro-Bund October 2019 Put 173,00, due 9/20/2019	(25)	–
EUR	(3) Euro-Bund October 2019 Put 173,50, due 9/20/2019	(445)	(0,01)
EUR	(2) Euro-Bund October 2019 Put 174,00, due 9/20/2019	(347)	(0,01)
EUR	(1) Euro-Bund October 2019 Put 175,50, due 9/20/2019	(293)	–
EUR	– Euro-Bund October 2019 Put 176,00, due 9/20/2019	(80)	–
	(2) U.S. 10 Year December 2019 Put 129,00, due 11/22/2019	(648)	(0,01)
	(1) U.S. 10 Year December 2019 Put 129,50, due 11/22/2019	(209)	–
	(1) U.S. 10 Year December 2019 Put 130,00, due 11/22/2019	(480)	(0,01)

Kontrakte (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
	(1) U.S. 10 Year November 2019 Call 132,00, due 10/25/2019	(688)	(0,01)
	(1) U.S. 10 Year November 2019 Call 132,50, due 10/25/2019	(809)	(0,01)
	(2) U.S. 10 Year November 2019 Call 133,00, due 10/25/2019	(1.326)	(0,02)
	(3) U.S. 10 Year November 2019 Put 129,50, due 10/25/2019	(824)	(0,01)
	(1) U.S. 10 Year November 2019 Put 130,00, due 10/25/2019	(507)	(0,01)
	(2) U.S. 10 Year November 2019 Put 131,00, due 10/25/2019	(1.127)	(0,02)
	(5) U.S. 10 Year October 2019 Call 128,00, due 9/20/2019	(17.407)	(0,26)
	(1) U.S. 10 Year October 2019 Call 128,50, due 9/20/2019	(2.526)	(0,04)
	(1) U.S. 10 Year October 2019 Call 130,00, due 9/20/2019	(1.782)	(0,03)
	(1) U.S. 10 Year October 2019 Call 130,50, due 9/20/2019	(1.109)	(0,02)
	(1) U.S. 10 Year October 2019 Call 131,00, due 9/20/2019	(551)	(0,01)
	(3) U.S. 10 Year October 2019 Call 131,50, due 9/20/2019	(2.348)	(0,04)
	(5) U.S. 10 Year October 2019 Call 132,00, due 9/20/2019	(2.394)	(0,04)
	(1) U.S. 10 Year October 2019 Call 132,50, due 9/20/2019	(265)	–
	(1) U.S. 10 Year October 2019 Call 132,75, due 9/20/2019	(325)	(0,01)
	(1) U.S. 10 Year October 2019 Call 133,00, due 9/20/2019	(168)	–
	(1) U.S. 10 Year October 2019 Put 128,50, due 9/20/2019	(8)	–
	(6) U.S. 10 Year October 2019 Put 129,00, due 9/20/2019	(187)	–
	(4) U.S. 10 Year October 2019 Put 129,50, due 9/20/2019	(263)	–
	– U.S. 10 Year October 2019 Put 129,75, due 9/20/2019	(20)	–
	(4) U.S. 10 Year October 2019 Put 130,00, due 9/20/2019	(430)	(0,01)
	(1) U.S. 10 Year October 2019 Put 130,25, due 9/20/2019	(80)	–
	(1) U.S. 10 Year October 2019 Put 130,50, due 9/20/2019	(103)	–
	(1) U.S. 10 Year October 2019 Put 130,75, due 9/20/2019	(205)	–
	(3) U.S. 10 Year October 2019 Put 131,00, due 9/20/2019	(1.084)	(0,02)
	(1) U.S. 10 Year W1 September 2019 Put 130,75, due 9/6/2019	(48)	–
	(1) U.S. 10 Year W1 September 2019 Put 131,00, due 9/6/2019	(85)	–
	– U.S. 10 Year W1 September 2019 Put 131,25, due 9/6/2019	(66)	–
	– U.S. 10 Year W1 September 2019 Put 131,50, due 9/6/2019	(64)	–
	(1) U.S. 5 Year October 2019 Call 118,25, due 9/20/2019	(2.265)	(0,03)
	(1) U.S. 5 Year October 2019 Put 118,00, due 9/20/2019	(6)	–
	(1) U.S. 5 Year October 2019 Put 118,25, due 9/20/2019	(16)	–
	(3) U.S. 5 Year October 2019 Put 118,50, due 9/20/2019	(67)	–
	(3) U.S. 5 Year October 2019 Put 118,75, due 9/20/2019	(160)	–
	(2) U.S. 5 Year October 2019 Put 119,00, due 9/20/2019	(161)	–
	(5) U.S. 5 Year October 2019 Put 119,25, due 9/20/2019	(678)	(0,01)
	(4) U.S. 5 Year October 2019 Put 119,50, due 9/20/2019	(805)	(0,01)
	(1) U.S. Bond November 2019 Call 166,00, due 10/25/2019	(1.449)	(0,02)
	(1) U.S. Bond November 2019 Call 167,00, due 10/25/2019	(1.186)	(0,02)

Kontrakte (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
	(1) U.S. Bond November 2019 Call 168,00, due 10/25/2019	(1.773)	(0,03)
	(1) U.S. Bond November 2019 Call 170,00, due 10/25/2019	(677)	(0,01)
	– U.S. Bond November 2019 Put 161,00, due 10/25/2019	(362)	(0,01)
	(1) U.S. Bond November 2019 Put 162,00, due 10/25/2019	(628)	(0,01)
	(1) U.S. Bond November 2019 Put 163,00, due 10/25/2019	(1.058)	(0,02)
	– U.S. Bond October 2019 Call 156,00, due 9/20/2019	(1.205)	(0,02)
	(1) U.S. Bond October 2019 Call 161,00, due 9/20/2019	(3.547)	(0,05)
	(2) U.S. Bond October 2019 Call 162,00, due 9/20/2019	(6.764)	(0,10)
	– U.S. Bond October 2019 Call 163,00, due 9/20/2019	(776)	(0,01)
	(1) U.S. Bond October 2019 Call 164,00, due 9/20/2019	(2.109)	(0,03)
	(2) U.S. Bond October 2019 Call 166,00, due 9/20/2019	(2.540)	(0,04)
	– U.S. Bond October 2019 Call 168,00, due 9/20/2019	(129)	–
	– U.S. Bond October 2019 Put 154,00, due 9/20/2019	–	–
	(1) U.S. Bond October 2019 Put 157,00, due 9/20/2019	(37)	–
	(1) U.S. Bond October 2019 Put 158,00, due 9/20/2019	(57)	–
	(1) U.S. Bond October 2019 Put 159,00, due 9/20/2019	(73)	–
	(1) U.S. Bond October 2019 Put 160,00, due 9/20/2019	(89)	–
	(2) U.S. Bond October 2019 Put 162,00, due 9/20/2019	(991)	(0,02)
	– U.S. Bond October 2019 Put 163,00, due 9/20/2019	(303)	(0,01)
	– U.S. Bond October 2019 Put 163,50, due 9/20/2019	(341)	(0,01)
	– U.S. Bond October 2019 Put 164,00, due 9/20/2019	(139)	–
	– U.S. Long Bond W1 September 2019 Put 163,50, due 9/6/2019	(97)	–
	– U.S. Long Bond W1 September 2019 Put 165,50, due 9/6/2019	(130)	–
(67.360)	USD Call/BRL Put 4,1816, due 11/20/2019	(1.434)	(0,02)
(67.360)	USD Call/RUB Put 70,4550, due 11/21/2019	(534)	(0,01)
(104.050)	USD Put/BRL Call 3,7460, due 10/9/2019	(13)	–
(66.600)	USD Put/BRL Call 4,06, due 9/30/2019	(428)	(0,01)
(74.500)	USD Put/EUR Call 1,2150, due 10/22/2019	(2)	–
(135.660)	USD Put/RUB Call 64,25, due 11/4/2019	(278)	–
Veräußerte Optionen gesamt (Anschaffungskosten USD (64.374))		(77.844)	(1,18)
Zinsswaps – (10,50 %) (28. Februar 2019: (1,35 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(692.412)	(10,50)
Devisenterminkontrakte – (2,44 %) (28. Februar 2019: (0,46 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(160.631)	(2,44)
Futures – (5,95 %) (28. Februar 2019: (1,60 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(392.074)	(5,95)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		(1.322.961)	(20,07)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzieller Vermögenswerte		5.109.582	77,51
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		1.482.132	22,49
Nettovermögen insgesamt		USD 6.591.714	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

– Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Registrierung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 31. August 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 733.000.000 oder 11,10 % des Nettovermögens.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

† Illiquide.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

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

ABKÜRZUNGEN:

CPI – Verbraucherpreisindex (Consumer Price Index)
Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen
ARS – Argentinischer Peso
AUD – Australischer Dollar
BRL – Brasilianischer Real
CNY – Chinesischer Renminbi
EGP – Ägyptisches Pfund
EUR – Euro
GBP – Britisches Pfund
IDR – Indonesische Rupiah
INR – Indische Rupie
JPY – Japanischer Yen
MXN – Mexikanischer Peso
RUB – Russischer Rubel
ZAR – Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögens werte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	70,25
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	1,90
Investmentfonds	0,31
Derivate	4,85
Sonstige Vermögenswerte	22,69
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kauf/Verkauf Schutz	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)		wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 %	Verkauf	20.06.24	107.734	USD	7.224
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 %	Verkauf	20.06.24	1.592.495		33.662
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 68.052)					USD	40.886
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (763))						–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 67.289)					USD	40.886

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)		wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 1,705 %	28.09.19	281.470	USD	(161)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,440 %	28.05.20	3.543.400		(347)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 1,671 %	14.06.20	76.430		(137)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 9,230 %	4.1.21	700.000		11.340
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 9,230 %	4.1.21	3.777.900		61.200
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD Fed Funds Rate, Receive Fixed 1,800 %	15.6.21	429.550		4.190
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 2,250 %	26.4.22	772.441		8.249
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 1,850 %	15.6.22	469.370		5.562
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,300 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	26.4.23	786.924		(8.616)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,127 %, Receive Floating JPY 6M Libor BBA	20.6.24	55.005.400		(7.615)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,250 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	31.12.25	664.516		(37.601)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	30.1.26	2.136.892		(155.401)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,550 %, Receive Floating USD Fed Funds Rate	30.4.26	487.937		(15.959)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,850 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	30.4.26	558.051		(19.111)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,100 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	30.4.26	1.642.000		(82.215)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,738 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	23.5.26	430.920		(11.506)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,735 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	27.5.26	273.070		(7.247)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,300 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	30.6.26	866.229		(784)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,433 %	17.7.29	4.732.430		9.305
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,440 %	20.7.29	678.580		1.353
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 3,000 %	15.2.36	256.629		57.811
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,950 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.43	639.791		(188.477)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,330 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.2.44	110.819		(41.784)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,000 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.5.44	190.328		(59.023)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,750 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.8.44	60.981		(15.796)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,810 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.44	119.278		(6.982)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,850 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.44	191.484		(12.857)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,785 %, Receive Floating JPY 6M Libor BBA	19.4.47	6.782.000		(12.437)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,498 %, Receive Floating EUR 6M Euribor Reuters	23.8.47	17.281		(7.822)
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	4.1.27	187.473		(166)
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	4.1.27	148.100		(131)
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	4.1.27	175.700		(155)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,044 %	4.1.27	122.000		(82)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 159.791)					USD 159.010
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (94.559))					(692.412)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 65.232)					USD (533.402)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Wirksamkeits-Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Swaption Payer Strike 1.10 %	17.10.19	800.000	USD 66
Morgan Stanley	Swaption Payer Strike 1.15 %	17.10.19	700.000	44
Nicht realisierte Wertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 431)				110
Nicht realisierte Wertminderung von Swaptions (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (175))				–
Nettowertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 256)				USD 110

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	243	Verkauf	AUD	361	USD –
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	170.861	Verkauf	BRL	704.493	734
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	10	Verkauf	CHF	9	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	4.687	Verkauf	EUR	4.232	37
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	5.903	Verkauf	GBP	4.835	22
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SEK	2	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	508	Verkauf	SGD	705	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	BRL	704.493	Verkauf	USD	185.851	(15.725)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	6	Verkauf	USD	4	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	155	Verkauf	USD	189	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	31.587	Verkauf	USD	34.983	(268)
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	246	Verkauf	AUD	364	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	10	Verkauf	CHF	10	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	42	Verkauf	CNH	297	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1.087	Verkauf	EUR	982	7
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	286	Verkauf	GBP	235	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	NOK	20	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	11	Verkauf	SEK	109	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	460	Verkauf	SGD	639	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	230	Verkauf	USD	155	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	777	Verkauf	USD	947	(1)
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	CHF	154	Verkauf	USD	156	(1)
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.116	Verkauf	USD	3.446	(21)
04.09.19	Citi	Kauf	USD	24.755	Verkauf	BRL	102.980	(114)
04.09.19	Goldman Sachs	Kauf	BRL	102.980	Verkauf	USD	24.859	9
09.09.19	Barclays	Kauf	USD	22.294	Verkauf	INR	1.674.640	(1.112)
09.09.19	JP Morgan	Kauf	INR	1.674.640	Verkauf	USD	23.285	121
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.412	Verkauf	AUD	3.560	14
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1.920	Verkauf	AUD	2.852	(3)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	4.844	Verkauf	CHF	4.728	60
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	78	Verkauf	CNH	557	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	118	Verkauf	CNH	827	2
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	156.103	Verkauf	EUR	140.277	1.816
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	20.962	Verkauf	GBP	17.344	(147)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	16.685	Verkauf	GBP	13.662	55
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.882	Verkauf	JPY	304.922	10
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	56	Verkauf	NOK	500	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	131	Verkauf	PLN	516	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	4.189	Verkauf	SEK	40.455	63
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	5.680	Verkauf	SGD	7.889	(5)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	7.805	Verkauf	SGD	10.819	8
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.948.589	Verkauf	USD	2.188.203	(44.913)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	171.189	Verkauf	USD	123.998	(628)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	681.436	Verkauf	USD	70.959	(1.482)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	5.906	Verkauf	USD	7.159	32
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	364	Verkauf	USD	246	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	JPY	108.645	Verkauf	USD	1.021	3
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	JPY	9.926.048	Verkauf	USD	93.599	(94)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CNH	45.092	Verkauf	USD	6.376	(80)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	18.471	Verkauf	USD	4.791	(151)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NOK	8.625	Verkauf	USD	965	(19)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	3.701	Verkauf	USD	2.664	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	776.652	Verkauf	USD	945.967	(510)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CHF	105.917	Verkauf	USD	108.864	(1.754)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	206.944	Verkauf	USD	140.410	(996)
18.09.19	Citi	Kauf	MXN	996.000	Verkauf	USD	49.976	(417)
23.09.19	Goldman Sachs	Kauf	BRL	79.764	Verkauf	USD	19.690	(455)
23.09.19	JP Morgan	Kauf	USD	3.987	Verkauf	ARS	196.044	933
27.09.19	Citi	Kauf	USD	38.820	Verkauf	MXN	757.654	1.180
27.09.19	Citi	Kauf	ARS	679.596	Verkauf	USD	13.062	(2.630)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
27.09.19	JP Morgan	Kauf	USD	38.661	Verkauf	INR	2.712.090	USD 945
01.10.19	BNY Mellon	Kauf	BRL	669.137	Verkauf	USD	161.773	(501)
10.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	4.160	Verkauf	BRL	15.981	311
10.10.19	JP Morgan	Kauf	BRL	148.858	Verkauf	USD	38.750	(2.896)
15.10.19	Citi	Kauf	ARS	562.253	Verkauf	USD	11.862	(3.713)
16.10.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	25.931	Verkauf	INR	1.799.070	1.004
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	38.947	Verkauf	CAD	51.039	586
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	69.411	Verkauf	CNH	478.260	2.718
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	68.153	Verkauf	EUR	60.720	1.180
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	72.693	Verkauf	GBP	57.839	2.178
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	224.856	Verkauf	IDR	3.229.156.552	(1.162)
17.10.19	Barclays	Kauf	EUR	45.714	Verkauf	USD	50.781	(359)
17.10.19	Barclays	Kauf	MXN	1.275.482	Verkauf	USD	66.105	(2.955)
17.10.19	Barclays	Kauf	INR	11.457.180	Verkauf	USD	163.010	(4.294)
17.10.19	Barclays	Kauf	PLN	3	Verkauf	USD	1	–
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	156.621	Verkauf	ZAR	2.230.278	10.457
17.10.19	BNP Paribas	Kauf	USD	51.722	Verkauf	BRL	206.780	1.943
17.10.19	BNP Paribas	Kauf	USD	66.841	Verkauf	INR	4.663.543	2.237
17.10.19	BNP Paribas	Kauf	CLP	34.207.794	Verkauf	USD	49.475	(2.047)
17.10.19	BNP Paribas	Kauf	BRL	135.420	Verkauf	USD	34.068	(1.468)
17.10.19	Citi	Kauf	USD	6.685	Verkauf	AUD	9.900	9
17.10.19	Citi	Kauf	USD	6.682	Verkauf	CAD	8.880	7
17.10.19	Citi	Kauf	USD	280.210	Verkauf	EUR	249.700	4.793
17.10.19	Citi	Kauf	USD	8.862	Verkauf	GBP	7.300	(37)
17.10.19	Citi	Kauf	USD	2.640	Verkauf	GBP	2.120	56
17.10.19	Citi	Kauf	USD	134.389	Verkauf	JPY	14.465.483	(2.228)
17.10.19	Citi	Kauf	USD	68.527	Verkauf	JPY	7.215.117	386
17.10.19	Citi	Kauf	USD	23.166	Verkauf	MXN	468.060	(8)
17.10.19	Citi	Kauf	USD	174.966	Verkauf	MXN	3.395.180	6.868
17.10.19	Citi	Kauf	USD	462.590	Verkauf	RUB	29.852.907	17.845
17.10.19	Citi	Kauf	COP	291.812.661	Verkauf	USD	89.982	(5.393)
17.10.19	Citi	Kauf	MXN	1.575.000	Verkauf	USD	80.628	(2.649)
17.10.19	Citi	Kauf	BRL	270.940	Verkauf	USD	65.005	220
17.10.19	Citi	Kauf	CAD	4.500	Verkauf	USD	3.387	(5)
17.10.19	Citi	Kauf	BRL	1.201.404	Verkauf	USD	315.931	(26.711)
17.10.19	Citi	Kauf	ZAR	35.000	Verkauf	USD	2.263	30
17.10.19	Citi	Kauf	AUD	164.362	Verkauf	USD	114.151	(3.309)
17.10.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	62.867	Verkauf	BRL	252.265	2.138
17.10.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	70.846	Verkauf	MXN	1.385.790	2.234
17.10.19	Goldman Sachs	Kauf	MXN	177.190	Verkauf	USD	8.952	(179)
17.10.19	Goldman Sachs	Kauf	PEN	173.776	Verkauf	USD	52.537	(1.444)
17.10.19	HSBC	Kauf	CNH	128.000	Verkauf	USD	18.112	(262)
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	267.715	Verkauf	EUR	236.011	7.397
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	23.158	Verkauf	INR	1.674.640	(41)
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	203.196	Verkauf	KRW	234.143.139	9.521
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	–	Verkauf	NOK	–	–
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	–	Verkauf	PHP	–	–
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	110.844	Verkauf	TWD	3.417.216	1.772
17.10.19	JP Morgan	Kauf	ARS	744.495	Verkauf	USD	15.533	(4.808)
17.10.19	JP Morgan	Kauf	SEK	641.662	Verkauf	USD	69.212	(3.635)
17.10.19	JP Morgan	Kauf	INR	2.137.140	Verkauf	USD	29.846	(240)
23.10.19	Citi	Kauf	EUR	30.351	Verkauf	USD	34.300	(807)
24.10.19	Citi	Kauf	ARS	173.055	Verkauf	USD	3.587	(1.146)
25.10.19	JP Morgan	Kauf	ARS	1.492.567	Verkauf	USD	27.231	(6.248)
04.11.19	BNP Paribas	Kauf	ARS	711.269	Verkauf	USD	12.295	(2.592)
05.11.19	Citi	Kauf	RUB	586.085	Verkauf	USD	8.870	(162)
21.11.19	Barclays	Kauf	RUB	2.046.436	Verkauf	USD	30.340	8
21.11.19	Citi	Kauf	USD	19.690	Verkauf	BRL	80.149	448
21.11.19	Citi	Kauf	USD	229.008	Verkauf	EUR	204.100	3.304
21.11.19	Citi	Kauf	USD	30.312	Verkauf	RUB	2.046.436	(36)
21.11.19	Royal Bank of Canada	Kauf	CAD	47.695	Verkauf	USD	36.107	(246)
21.11.19	UBS	Kauf	USD	71.894	Verkauf	AUD	106.214	198
21.11.19	UBS	Kauf	USD	135.152	Verkauf	EUR	119.989	2.462
21.11.19	UBS	Kauf	AUD	2.800	Verkauf	USD	1.903	(13)
21.11.19	UBS	Kauf	EUR	10.000	Verkauf	USD	11.158	(99)
27.01.20	JP Morgan	Kauf	ARS	1.092.005	Verkauf	USD	19.647	(7.412)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 78.254)								88.363
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (31.992))								(160.631)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 46.262)								USD (72.268)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nominelle wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro$ December 2019	23.832	USD 5.847.181	USD 43.332
90 Day Euro$ June 2020	4.801	1.183.507	11.771
90 Day Euro$ June 2021	(10.551)	(2.607.548)	(22.294)
90 Day Euro$ March 2020	560	137.830	1.176
90 Day Euro$ March 2021	3.042	751.640	9.972
Australia 10 Year Bond September 2019	190	19.038	659
Australian Dollar Currency September 2019	239	16.087	(665)
British Pound Currency September 2019	1.236	93.944	(4.239)
Canadian 10 Year Bond December 2019	699	76.169	82
Canadian Dollar Currency September 2019	222	16.669	(166)
Euro FX Currency December 2019	(54)	(7.468)	90
Euro FX Currency September 2019	1.112	152.754	(5.566)
Euro-BTP December 2019	2.768	436.673	(1.779)
Euro-Bund September 2019	(28.243)	(5.559.352)	(251.500)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2019	(2.423)	(597.311)	(65.557)
Euro-OAT September 2019	(3.037)	(568.764)	(16.669)
Fed Fund 30 Day November 2019	(5.126)	(2.099.478)	1.284
Fed Fund 30 Day September 2019	(1.000)	(407.835)	164
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2019	(495)	(723.151)	(8.016)
Japanese Yen Currency September 2019	115	13.543	196
Long Gilt December 2019	(5.269)	(860.913)	2.747
Mexican Peso Currency September 2019	3.202	79.730	(1.402)
RUB/USD September 2019	10.211	381.636	(8.441)
Short Euro-BTP September 2019	1.062	131.834	2.960
U.S. 10 Year Note (CBT) December 2019	(30.984)	(4.081.174)	(4.715)
U.S. 10 Year Ultra Note December 2019	(86)	(12.422)	(42)
U.S. 2 Year Note (CBT) December 2019	14.071	3.040.985	(1.023)
U.S. 5 Year Note (CBT) December 2019	55.651	6.676.816	4.756
U.S. 5 Year Note (CBT) September 2019	(523)	(62.515)	28
U.S. Long Bond (CBT) December 2019	25.897	4.279.479	9.464
U.S. Ultra Bond (CBT) December 2019	8.083	1.595.887	17.926
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 134.631)			USD 106.607
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (111.918))			(392.074)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 22.713)			USD (285.467)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 88,40 % (28. Februar 2019: 89,81 %)			
Argentinien – 1,49 % (28. Februar 2019: 6,19 %)			
ARS 34.150	Argentina POM Politica Monetaria, Serie POM, 66,777 %, due 6/21/2020 *	195	0,56
ARS 11.300	Argentinische Bonos del Tesoro, 15,500 %, due 10/17/2026	60	0,17
ARS 21.354	Bonos de la Nacion Argentinien con Ajuste por CER, 4,000 %, due 3/6/2020 β	267	0,76
		522	1,49
Brasilien – 8,50 % (28. Februar 2019: 9,48 %)			
BRL 300	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie B, Series Ob, 6,000 %, due 8/15/2022 β	256	0,73
BRL 1.707	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series Ob, 10,000 %, due 1/1/2021	434	1,24
BRL 6.034	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series Ob, 10,000 %, due 1/1/2025	1.641	4,68
BRL 2.320	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series Ob, 10,000 %, due 1/1/2029	652	1,85
		2.983	8,50
Chile – 2,86 % (28. Februar 2019: 2,19 %)			
CLP 480.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos, 5,000 %, due 3/1/2035	851	2,43
CLP 25.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos, Serie 30YR, 6,000 %, due 1/1/2043	53	0,15
CLP 50.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos, 5,100 %, due 7/15/2050	99	0,28
		1.003	2,86
Kolumbien – 5,76 % (28. Februar 2019: 6,34 %)			
COP 1.509.000	Regierung Kolumbiens Internationale Anleihe, 7,750 %, due 4/14/2021	458	1,31
COP 848.100	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, due 5/4/2022	260	0,74
COP 1.485.100	Kolumbianische TES, Serie B, 7,500 %, due 8/26/2026	478	1,36
COP 803.900	Kolumbianische TES, Serie B, 6,000 %, due 4/28/2028	235	0,67
COP 1.894.300	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, due 6/30/2032	591	1,68
		2.022	5,76
Tschechische Republik – 1,92 % (28. Februar 2019: 1,06 %)			
CZK 16.150	Tschechische Republik Staatsanleihen, Serie 94, 0,950 %, due 5/15/2030	674	1,92
Ägypten – 1,06 % (28. Februar 2019: 1,14 %)			
EGP 6.475	Schatzanweisungen Ägyptens, Call 120,50, due 1/21/2020	370	1,06
Ghana – 0,57 % (28. Februar 2019: 1,14 %)			
GHS 1.110	Republik Ghana Staatsanleihen, Serie 5Y, 18,250 %, due 7/25/2022	201	0,57
Ungarn – 0,95 % (28. Februar 2019: 1,50 %)			
HUF 88.970	Ungarische Staatsanleihe, Serie 31/A, 3,250 %, due 10/22/2031	334	0,95
Indonesien – 13,55 % (28. Februar 2019: 12,85 %)			
IDR 20.697.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR61, 7,000 %, due 5/15/2022	1.480	4,22
IDR 16.395.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR56, 8,375 %, due 9/15/2026	1.228	3,50
IDR 3.941.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR64, 6,125 %, due 5/15/2028	257	0,73
IDR 1.152.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR78, 8,250 %, due 5/15/2029	87	0,25
IDR 7.464.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR65, 6,625 %, due 5/15/2033	480	1,37
IDR 2.648.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR68, 8,375 %, due 3/15/2034	197	0,56
IDR 11.883.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR72, 8,250 %, due 5/15/2036	874	2,49
IDR 1.500.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR75, 7,500 %, due 5/15/2038	103	0,30
IDR 623.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR67, 8,750 %, due 2/15/2044	47	0,13
		4.753	13,55
Malaysia – 5,93 % (28. Februar 2019: 5,85 %)			
MYR 1.910	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0112, 3,418 %, due 8/15/2022	457	1,31
MYR 1.300	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0115, 3,955 %, due 9/15/2025	320	0,91
MYR 1.570	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0316, 3,900 %, due 11/30/2026	387	1,10
MYR 860	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0513, 3,733 %, due 6/15/2028	211	0,60
MYR 870	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0411, 4,232 %, due 6/30/2031	222	0,63
MYR 1.865	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0415, 4,254 %, due 5/31/2035	483	1,38
		2.080	5,93
Mexiko – 7,05 % (28. Februar 2019: 5,83 %)			
MXN 2.640	Mexican Bonos, Series M 20, 6,500 %, due 6/9/2022	130	0,37
MXN 24.930	Mexican Bonos, Series M 20, 5,750 %, due 3/5/2026	1.168	3,33
MXN 12.320	Mexican Bonos, Series M 20, 7,750 %, due 11/23/2034	643	1,83
MXN 10.320	Mexican Bonos, Series M 20, 7,750 %, due 11/13/2042	531	1,52
		2.472	7,05
Nigeria – 0,54 % (28. Februar 2019: 0,50 %)			
NGN 73.760	Nigeria OMO Bill, zero coupon, due 2/20/2020	191	0,54
Peru – 3,93 % (28. Februar 2019: 2,85 %)			
PEN 1.090	Peru Government Bond, 6,350 %, due 8/12/2028	375	1,07
PEN 2.430	Peru Government Bond,144A, 6,150 %, due 8/12/2032	825	2,35
PEN 490	Peru Government Bond, 6,850 %, due 3/6/2019	178	0,51
		1.378	3,93
Philippinen – 1,70 % (28. Februar 2019: 0,54 %)			
PHP 10.000	Philippinische Regierung Internationale Anleihe, 4,950 %, due 1/15/2021	195	0,56
PHP 21.000	Philippinische Regierung Internationale Anleihe, 3,900 %, due 11/26/2022	402	1,14
		597	1,70
Polen – 4,79 % (28. Februar 2019: 4,29 %)			
PLN 730	Republik Polen Staatsanleihen, Serie 0422, 2,250 %, due 4/25/2022	187	0,53
PLN 5.640	Republik Polen Staatsanleihen, Serie 0727, 2,500 %, due 7/25/2027	1.492	4,26
		1.679	4,79
Sambia – 0,76 % (28. February 2019: 0,61 %)			
200	Regierung Von Katar Internationale Anleihe, 5,103 %, due 4/23/2048	267	0,76
Rumänien – 1,59 % (28. Februar 2019: 1,57 %)			
RON 1.040	Staatsanleihe Rumänien, Serie 7Y, 3,500 %, due 12/19/2022	242	0,69
RON 300	Staatsanleihe Rumänien, Serie 7Y, 3,250 %, due 4/29/2024	68	0,19
RON 1.000	Staatsanleihe Rumänien, Serie 10Y, 5,000 %, due 2/12/2029	248	0,71
		558	1,59
Russland – 8,83 % (28. Februar 2019: 7,27 %)			
RUB 98.280	Russische Bundesanleihe - OFZ, Serie 6211, 7,000 %, due 1/25/2023	1.488	4,24
RUB 74.938	Russische Bundesanleihe - OFZ, Serie 6212, 7,050 %, due 1/19/2028	1.133	3,23
RUB 30.340	Russische Bundesanleihe - OFZ, Serie 6221, 7,700 %, due 3/23/2033	475	1,36
		3.096	8,83
Südafrika – 7,07 % (28. Februar 2019: 7,20 %)			
ZAR 9.820	Republik Südafrika Staatsanleihen, Serie R213, 7,000 %, due 2/28/2031	550	1,56
ZAR 15.410	Republik Südafrika Staatsanleihen, Serie R209, 6,250 %, due 3/31/2036	736	2,10
ZAR 25.800	Republik Südafrika Staatsanleihen, Serie R214, 6,500 %, due 2/28/2041	1.196	3,41
		2.482	7,07
Thailand – 6,15 % (28. Februar 2019: 3,98 %)			
THB 4.360	Thailändische Staatsanleihen, 2,125 %, due 12/17/2026	150	0,43
THB 19.610	Thailändische Staatsanleihen, 3,650 %, due 6/20/2031	793	2,26
THB 11.000	Thailändische Staatsanleihen, 3,775 %, due 6/25/2032	456	1,30
THB 15.200	Thailändische Staatsanleihen, 3,400 %, due 6/17/2036	637	1,81
THB 2.900	Thailändische Staatsanleihen, 3,300 %, due 6/17/2038	121	0,35
		2.157	6,15
Türkei – 2,90 % (28. Februar 2019: 4,85 %)			
TRY 1.200	Staatsanleihen Der Türkei, 7,100 %, due 3/8/2023	158	0,45
TRY 880	Staatsanleihen Der Türkei, 8,800 %, due 9/27/2023	119	0,34
TRY 3.700	Staatsanleihen Der Türkei, 10,600 %, due 2/11/2026	508	1,45
TRY 1.137	Staatsanleihen Der Türkei, 11,000 %, due 2/24/2027	154	0,44
TRY 590	Staatsanleihen Der Türkei, 10,500 %, due 8/11/2027	78	0,22
		1.017	2,90
Ukraine – 0,50 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
UAH 4.400	Staatsanleihen Der Ukraine, 17,250 %, due 9/30/2020	177	0,50
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 36.367)		31.013	88,40
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 36.367)		31.013	88.40

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Kontrakte (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Gekaufte Optionen – 0,47 % (28. Februar 2019: 0,39 %)			
EUR 950	EUR Put/USD Call 1,11, due 9/6/2019	11	0,03
EUR 1.570	EUR Put/USD Call 1,15, due 10/22/2019	76	0,22
725	USD-Anruf/RUB Put 65,70, due 9/16/2019	14	0,04
750	USD-Anruf/ZAR Put 14,35, due 10/28/2019	48	0,14
360	USD Put/BRL Call 3,80, due 9/30/2019	-	-
540	USD Put/COP Call 3.050,00, due 9/3/2019	-	-
380	USD Put/IDR Call 14.000,00, due 1/15/2020	2	0,01
1.700	USD Put/IDR Call 14.100,00, due 11/1/2019	8	0,02
865	USD Put/INR Call 68,50, due 1/14/2020	1	-
360	USD Put/INR Call 69,20, due 9/24/2019	-	-
610	USD Put/MXN Call 18,80, due 10/9/2019	-	-
550	USD Put/MXN Call 18,95, due 10/1/2019	-	-
360	USD Put/ZAR Call 14,60, due 11/23/2019	4	0,01
Gekaufte Optionen insgesamt (Anschaffungskosten USD 131)		164	0,47
Zinsswaps – 0,34 % (28. Februar 2019: 0,19 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		119	0,34
Devisenterminkontrakte – 1,18 % (28. Februar 2019: 0,28 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		415	1,18
Futures – 0,01 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		4	0,01
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		(31.715)	(90,40)
Verkaufte Optionen – (0,44 %) (28. Februar 2019: 0,35 %)			
EUR (950)	EUR-Anruf/USD Put 1,1550, due 9/6/2019	-	-
EUR (1.570)	EUR-Anruf/USD Put 1,22, due 10/22/2019	-	-
(360)	USD-Anruf/BRL Put 3,95, due 9/30/2019	(16)	(0,05)
(540)	USD-Anruf/COP Put 3.250,00, due 9/3/2019	(30)	(0,09)
(380)	USD-Anruf/IDR Put 15.000,00, due 1/15/2020	(3)	(0,01)
(1.700)	USD-Anruf/IDR Put 15.300,00, due 11/1/2019	(2)	(0,01)
(360)	USD-Anruf/INR Put 71,50, due 9/24/2019	(4)	(0,01)
(865)	USD-Anruf/INR Put 71,70, due 1/14/2020	(23)	(0,06)
(610)	USD-Anruf/MXN Put 19,70, due 10/9/2019	(17)	(0,05)
(550)	USD-Anruf/MXN Put 20,30, due 10/1/2019	(5)	(0,02)
(725)	USD-Anruf/RUB Put 67,30, due 9/16/2019	(4)	(0,01)
(360)	USD Anruf/VERSUCH Put 5,60, due 9/13/2019	(16)	(0,04)
(750)	USD-Anruf/ZAR Put 14,90, due 10/28/2019	(28)	(0,08)
(360)	USD-Anruf/ZAR Put 16,50, due 11/23/2019	(3)	(0,01)
(540)	USD Put/COP Call 2.950,00, due 9/3/2019	-	-
(725)	USD Put/RUB Call 64,00, due 9/16/2019	-	-
(750)	USD Put/ZAR Call 13,80, due 10/28/2019	(1)	-
Veräußerte Optionen gesamt (Anschaffungskosten USD (182))		(152)	(0,44)
Devisenterminkontrakte – (1,03 %) (28. Februar 2019: 0,13 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(362)	(1,03)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(514)	(1,47)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten		31.201	88,93
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		3.881	11,07
Nettovermögen insgesamt		35.082 USD	100,00

- Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Registrierung befreite Wertpapiere gemäß Regel 144A von Das Securities Act von 1933 in der geänderten Fassung. Diese Wertpapiere dürfen nur weiterverkauft werden, bei Transaktionen ausgenommen Von der Registrierung bis hin zu qualifizierten institutionellen Käufern. Zum August 2019 betrugen diese Wertpapiere USD 27.954.000 und machten 2,35 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2018.

β Der Zinssatz für diese Art von Sicherheit ist an den gebunden Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI). Die Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2018.

Die Gegenparteien für OTC-Optionen sind Bank of America Merill Lynch, Barclays, Citi, Deutsche Bank, Goldman Sachs und JP Morgan.

ABKÜRZUNGEN:

ARS	- Argentinischer Peso
BRL	- Brasilianischer Real
CLP	- Chilenischer Peso
COP	- - Kolumbianischer Peso
CZK	- Tschechische Krone
EGP	- Ägyptisches Pfund
EUR	- Euro
GHS	- Ghanaischer Cedi
HUF	- Ungarischer Forint
IDR	- Indonesische Rupiah
MXN	- Mexikanischer Peso
MYR	- Malaysischer Ringgit
NGN	- Nigerianischer Naira
PEN	- Peruanischer neuer Sol
PHP	- Philippinischer Peso
PLN	- Polnischer Zloty
RON	- Rumänischer Leu
RUB	- Russischer Rubel
THB	- Thailändischer Baht
TRY	- Türkische Lira
UAH	- Ukrainisch Hryvnia
ZAR	- Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,44
Derivate	1,96
Sonstige Vermögenswerte	11,60
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Ende der Laufzeit	Nomineller Betrag (in Tsd.)		wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,845 %	2/24/28	7.000	USD	24
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 9,340 %	1/4/21	6.000		95
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 68)				USD	119
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (11))					-
Netto-Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 57				USD	119

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
13.09.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	224	Verkauf	COP	773.746	USD	(1)
13.09.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	339	Verkauf	COP	1.152.357		5
13.09.19	Barclays	Kauf	USD	214	Verkauf	PLN	839		3
13.09.19	Barclays	Kauf	PLN	7.811	Verkauf	USD	2.057		(95)
13.09.19	Citi	Kauf	USD	375	Verkauf	ARS	19.650		57
13.09.19	Citi	Kauf	ARS	4.753	Verkauf	USD	104		(28)
13.09.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	261	Verkauf	ARS	16.890		(12)
13.09.19	JP Morgan	Kauf	USD	225	Verkauf	COP	773.746		-
13.09.19	JP Morgan	Kauf	RON	1.345	Verkauf	USD	322		(8)
15.10.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	244	Verkauf	RUB	16.031		5
15.10.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	RUB	35.449	Verkauf	USD	550		(22)
15.10.19	Barclays	Kauf	USD	927	Verkauf	INR	66.762		3

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.10.19	Barclays	Kauf	USD	396	Verkauf	INR	28.631	USD –
15.10.19	Barclays	Kauf	USD	348	Verkauf	MXN	7.028	(1)
15.10.19	Barclays	Kauf	USD	491	Verkauf	PHP	25.236	8
15.10.19	Barclays	Kauf	INR	30.275	Verkauf	USD	437	(17)
15.10.19	Barclays	Kauf	ZAR	12.045	Verkauf	USD	845	(56)
15.10.19	Barclays	Kauf	USD	178	Verkauf	ZAR	2.679	2
15.10.19	Barclays	Kauf	USD	468	Verkauf	ZAR	7.202	(4)
15.10.19	Citi	Kauf	USD	970	Verkauf	ARS	45.970	304
15.10.19	Citi	Kauf	MXN	10.904	Verkauf	USD	568	(28)
15.10.19	Citi	Kauf	BRL	700	Verkauf	USD	180	(11)
15.10.19	Deutsche Bank	Kauf	EUR	313	Verkauf	RON	1.493	(2)
15.10.19	Deutsche Bank	Kauf	USD	183	Verkauf	TRY	1.076	2
15.10.19	Deutsche Bank	Kauf	USD	408	Verkauf	TRY	2.435	(3)
15.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	122	Verkauf	BRL	474	8
15.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	1.650	Verkauf	IDR	23.707.037	(10)
15.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	102	Verkauf	ZAR	1.449	7
17.10.19	Citi	Kauf	JPY	19.120	Verkauf	USD	180	-
14.11.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	1.406	Verkauf	SAR	5.280	(1)
14.11.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	SAR	1.400	Verkauf	USD	373	1
15.11.19	Barclays	Kauf	USD	222	Verkauf	PEN	756	-
15.11.19	Barclays	Kauf	HUF	254.892	Verkauf	USD	877	(28)
15.11.19	Barclays	Kauf	PEN	287	Verkauf	USD	84	-
15.11.19	Barclays	Kauf	THB	33.031	Verkauf	USD	1.077	6
15.11.19	Deutsche Bank	Kauf	USD	343	Verkauf	MYR	1.440	2
15.11.19	Deutsche Bank	Kauf	MYR	1.686	Verkauf	USD	402	(3)
15.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	33	Verkauf	CLP	23.255	-
15.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	261	Verkauf	CZK	6.100	2
15.11.19	JP Morgan	Kauf	CZK	31.460	Verkauf	USD	1.366	(32)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 99)								415
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (48))								(362)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 51)								USD 53

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) March 2019	7	USD 922	USD 4
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD–)			USD 4
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD–)			-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD–)			USD 4

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Asset-Backed Securities - 8,12 % 28. Februar 2019 7,09 %)			
2.230	Aegis Asset Backed Securities Trust Hypothekenpfand - Durchgriff Ctfs Lehman Mortgage Trust 2005-4, Series 2005 4, Class M2 2,615 %, due 10/25/2035 *	2.138	0,29
400	Ammc Clo 20 Ltd, Series 2017 20A, Class A1B, 144A, 8,113 %, due 4/17/2029 *	383	0,05
1.080	AMMC CLO XI Ltd, Serie 2012 11A, Klasse A1R2, 144A, 3,276 %, due 4/30/2031 *	1.068	0,14
500	ARES XLIV CLO LTD, Series 2017 44A, Class A1B, 144A, 8,853 %, due 10/15/2029 *	487	0,07
250	Avery Point VI CLO Ltd, Serie 2015 6A, Klasse E1, 144A, 7,787 %, due 8/5/2027 *	241	0,03
1.000	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Klasse C, 144A, 5,428 %, due 4/20/2031 *	948	0,13
250	Barings CLO Ltd 2017-I, Serie 2017 1A, Klasse F, 144A, 9,750 %, due 7/18/2029 *	218	0,03
868	BX Trust 1998-C, Series 1998 IMC, Class G, 144A, 7,510 %, due 1/15/2029	767	0,10
500	BlueMountain CLO 2015-2 Ltd, Serie 2015 2A, Klasse ER, 144A, 7,500 %, due 7/18/2027 *	466	0,06
1.250	BlueMountain CLO 2016-1 Ltd, Serie 2016 1A, Klasse DRR, 144A, 4,128 %, due 4/20/2027 *	1.225	0,17
500	Carlyle US Clo 2017-2 Ltd, Serie 2017 2A, Klasse C, 144A, 5,978 %, due 7/20/2031 *	497	0,07
700	Catskill Park CLO Ltd, Serie 2017 1A, Klasse D, 144A, 8,278 %, due 4/20/2029 *	664	0,09
780	Cent CLO 24 Ltd, Series 2015 24A, Class A1B, 144A, 5,453 %, due 10/15/2026 *	770	0,10
1.000	Cumberland Park CLO Ltd, Serie 2015 2A, Klasse DR, 144A, 4,978 %, due 7/20/2028 *	984	0,13
500	Cumberland Park CLO Ltd, Serie 2015 2A, Klasse er, 144A, 7,928 %, due 7/20/2028 *	480	0,07
500	CVP CLO 2017-2 Ltd, Series 2017 2A, Class A1B, 144A, 4,928 %, due 1/20/2031 *	458	0,06
1.709	CWABS Rovolving Home Equity Loan Trust Serie 2004-B, Serie 2004 B, Klasse 2A, 2,415 %, due 2/15/2029 *	1.581	0,22
179	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2005-D, Serie 2005 D, Klasse 2A, 2,385 %, due 11/15/2035 *	173	0,02
3.251	Dividende Solarkredite 2018-2 LLC, Serie 2018 2, Klasse B, 144A, 4,250 %, due 12/20/2038	3.490	0,47
12	Earnest Student Loan Program 2016-A LLC, Series 2016 2016 A, Class A1B, 144A, 0,000 %, due 1/25/2039	320	0,04
2.090	Nelnet Student Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Class M4 * 3,075 %, due 11/25/2035 *	2.077	0,28
431	First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, Serie 2003 DNA 2. Class M1. 4,030 %, due 10/25/2033 *	435	0,06
2.350	Flatiron Clo 17 Ltd, Series 2017 1A, Class A1B, 144A, 3,408 %, due 5/15/2030 *	2.352	0,32
250	Greenwood Park CLO Ltd, Serie 2018 1A, Klasse E, 144A, 7,253 %, due 4/15/2031 *	222	0,03
1.000	Grippen Park Clo Ltd, Series 2017 1A, Class A1B, 144A, 5,578 %, due 1/20/2030 *	983	0,13
800	Halcyon Loan Advisors Funding 2015-2 Ltd, Series 2015 2A, Class A1B, 144A, 3,356 %, due 7/25/2027 *	799	0,11
3.000	Hertz Fahrzeugfinanzierung II LP, Serie 2015 1A, Klasse 144A, 3,520 %, due 3/25/2021	3.013	0,41
3.500	Hertz Fahrzeugfinanzierung II LP, Serie 2016 2A, Klasse 144A, 5,970 %, due 3/25/2022	3.575	0,49
540	Hertz Fahrzeugfinanzierung II LP, Serie 2017 1A, Klasse 144A, 3,560 %, due 10/25/2021	545	0,07
3.330	Hypothek Für Eigenheimpapital Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-C, 2005 AR17, Class M2, 2,645 %, due 10/25/2035 *	3.283	0,45
1.000	Jackson Mill CLO Ltd, Series 2015 1A, Class A1B, 144A, 5,103 %, due 4/15/2027 *	993	0,13
850	Jamestown CLO IV Ltd, Serie 2014 4A, Klasse A2R, 144A, 3,653 %, due 7/15/2026 *	851	0,12
750	Jamestown CLO X Ltd, Serie 2017 10A, Klasse A1, 144A, 3,553 %, due 7/17/2029 *	751	0,10
1.300	LCM XXII Ltd 22A, Klasse DR, 144A, 7,778 %, due 10/20/2028 *	1.164	0,16
250	Oaktree CLO 2015-1 Ltd, Serie 2015 1A, Klasse DR, 144A, 7,478 %, due 10/20/2027 *	243	0,03
1.000	OCTAGON INVESTMENT Partners XXII Ltd, Series 2014 1A, Class A1B, 144A, 5,028 %, due 1/22/2030 *	941	0,13
1.240	Option Eine Hypothek Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Klasse 1A1, 5,866 %, due 1/25/2037	1.219	0,17
2.637	Option Eine Hypothek Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Klasse 2A1, 5,866 %, due 1/25/2037	2.655	0,36
750	BX Trust 2017-IMC, Series 2014 IMC, Class A2R, 144A, 3,903 %, due 7/17/2029 *	740	0,10
1.330	BX Trust 2017-IMC, Series 2014 IMC, Class CR, 144A, 5,303 %, due 7/17/2029 *	1.245	0,17
1.000	BX Trust 2017-IMC, Series 2014 IMC, Class DR, 144A, 8,413 %, due 7/17/2029 *	912	0,12
900	OZLM XI Ltd, Serie 2015 11A, KLASSE BR, 144A, 4,566 %, due 10/30/2030 *	889	0,12
1.200	TES 2017-1 LLC, Series 2015 12A, Class B, 144A, 7,666 %, due 4/30/2027 *	1.126	0,15
622	RBSSP-Reverbriefung Vertrauen 2010-4, Serie 2010 Class E, 144A, 5,825 %, due 2/26/2036	621	0,08
1.320	Saranac CLO III Ltd, Series 2014 3A, Class A1B, 144A, 5,593 %, due 6/22/2030 *	1.260	0,17
530	TCI-Symphony CLO 2016-1 Ltd, Serie 2016 1A, Klasse DRR, 144A, 5,303 %, due 10/13/2029 *	515	0,07
700	TCI-Symphony CLO 2016-1 Ltd, Serie 2016 1A, Klasse ER, 144A, 7,803 %, due 10/13/2029 *	666	0,09
400	Thayer Park CLO Ltd, Serie 2017 1A, Klasse D, 144A, 8,378 %, due 4/20/2029 *	378	0,05
600	Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Class A1B, 144A, 5,123 %, due 4/15/2027 *	582	0,08
500	Venture XVII CLO Ltd, Serie 2014 17A, Klasse ERR, 144A, 8,043 %, due 4/15/2027 *	452	0,06
2.300	Venture XXVI CLO Ltd, Serie 2017 26A, Klasse A, 144A, 3,728 %, due 1/20/2029 *	2.303	0,31
1.500	VOYA CLO 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class A1B, 144A, 5,633 %, due 4/17/2030 *	1.471	0,20
300	VOYA CLO 2017-2, Series 2017 2A, Class A1B, 144A, 8,323 %, due 6/7/2030 *	284	0,04
2.846	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Chase Issuance Trust, Series 2007 HE4, Class A2, 2.315 % due 7/25/2047 *	2.218	0,30
890	Whitehorse XII Ltd, Serie 2018 12A, Klasse D, 144A, 5,953 %, due 10/15/2031 *	860	0,12
Asset-Backed Securities insgesamt (Anschaffungskosten USD 60.183)		59.981	8,12
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 12,80 % (28. Februar 2019: 11,30 %)			
1.778	Alternative Loan Trust 2007 - 4CB, Serie 2007 DNA 2. Class 1A5. 5,750 %, due 4/25/2037	1,782	0,24
1.219	Motel 6 Trust 2016-RRGG10, Series 2016 GG10, Class F, 144A, 6,006 %, due 8/10/2045 *	906	0,12
1.859	Banc of America Funding Corp, Serie 2015 R3, Klasse 1A2, 144A, 2,751 %, due 3/27/2036 *	1.520	0,21
440	BBCCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Klasse D, 144A, 4,715 %, due 8/10/2033 *	449	0,06
350	BBCCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Klasse E, 144A, 4,715 %, due 8/10/2033 *	331	0,04
3.000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2015-SHP2, Series 2015 SHP2, Class AM * 7,395 %, due 7/15/2027 *	3.007	0,41
13	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Serie 2006-C3, 2006 C3, Class A1C4, 6,702 %, due 6/15/2038 *	7	-

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
391	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Serie 2006-C5, 2006 C5, Class A1C4, 5,373 %, due 12/15/2039	265	0,04
344	Credit Suisse Group Mortgage Trust Serie 2007-C5, Serie 2007 LDP 9. Class AM. 5,869 %, due 9/15/2040 *	261	0,04
3.250	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144A, 4,373 %, due 9/15/2037	2.999	0,41
2.000	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Klasse F, 144A, 6,545 %, due 7/15/2032 *	2.011	0,27
1.400	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Klasse H, 144A, 9,815 %, due 7/15/2032 *	1.402	0,19
3.670	CSWF 2018-TOP, Serie 2018 TOP, Klasse D, 144A 3,995 %, due 8/15/2035 *	3.677	0,50
3.056	DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 DNA 2. Class 1A1B. 2,322 %, due 4/19/2047 *	2.750	0,37
228	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, LDP 12. Series 2015 C02. Klasse 2M2, 6,145 %, due 5/25/2025 *	236	0,03
440	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C03, Class 1B1, 144A, 6,995 %, due 10/25/2029 *	495	0,07
2.500	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, LDP 12. Series 2017 C05. Klasse 1B1, 5,745 %, due 1/25/2030 *	2.613	0,35
3.400	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, LDP 12. Series 2017 C06. Klasse 1B1, 6,295 %, due 2/25/2030 *	3.659	0,50
2.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, LDP 12. Series 2017 C07. Klasse 1B1, 6,145 %, due 5/28/2030 *	2.143	0,29
3.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, LDP 12. Series 2018 C01. Klasse 1B1, 5,695 %, due 7/25/2030 *	3.116	0,42
6.692	Fannie Mae Pool BM5520 3,500 %, due 2/1/2047	6.980	0,95
900	Freddie Mac Strukturiert Kreditrisikorisiko Der Agentur Notes, Series 2017 DNA2, Klasse B1, 7,295 %, due 10/25/2029 *	1.026	0,14
1.710	GE Commercial Mortgage Corp Series 2007-C1 Trust, Serie 2007 C1, Klasse AJ, 5,677 %, fällig 12/10/2049 *	406	0,05
1.000	GS Hypothekenpapiere Series 2018 SRP5, Class A1, 144A, 5,945 %, due 9/15/2031 *	1.001	0,14
106	GS Hypothekenpapiere Vertrauen 2006-GG8, LDP 12. Series 2006 GG8. Klasse AMFX, 5,622 %, due 11/10/2039	94	0,01
279	GSMPS Hypothekenkredit Vertrauen 2006-RP1, LDP 12. Series 2006 RP1. Klasse 1A2, 144A, 7,500 %, due 1/25/2036	298	0,04
4.348	Impac Secured Assets Trust 2006-3, Series 2006 3, Class A7, 1,891 %, due 2,415 %, due 11/25/2036 *	3.383	0,46
3.190	JP Morgan Chase Kommerzielle Hypothek Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 USA, Class A2, 144A, 10,403 %, due 6/15/2035 *	3.183	0,43
275	JP Morgan Chase Kommerzielle Hypothek Securities Trust 2007-CIBC19, Serie 2007 CB19, Klasse AJ, 6,004 %, due 2/12/2049 *	184	0,02
1.610	JP Morgan Chase Kommerzielle Hypothek Securities Trust 2007 - LDP10, Serie 2007 LDPX, Klasse AJFX, 144A, 5,438 %, due 1/15/2049	319	0,04
1.021	JP Morgan Chase Kommerzielle Hypothek Securities Trust 2007 - LDP10, Serie 2007 LDPX, Klasse AM, 5,464 %, due 1/15/2049 *	1.019	0,14
5	JP Morgan Chase Kommerzielle Hypothek Securities Trust 2007-LDP 12. Series 2007 LD12. 6,613 %, due 2/15/2051 *	5	-
951	JP Morgan Chase Trust-Serie 2009-10, Series 2009 3A, Class 7A2, 144A, 6,054 %, due 2/26/2037 *	558	0,08
4.010	JPMCC-Werbespot BX Trust 2019-BOLT, Series 2019 IMC, Class G, 144A, 5,995 %, due 7/15/2034 *	4.017	0,54
5.595	JPMCC-Werbespot BX Trust 2019-BOLT, Series 2019 IMC, Class G, 144A, 2,052 %, due 7/15/2034 *	210	0,03
1.330	LSTAR Securities Lehman Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Class A2 4,730 %, due 4/1/2023 *	1.334	0,18
247	Ml-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJ, 5,450 %, fällig 8/12/2048 *	158	0,02
247	ML-CFC Commercial Mortgage Trust, Series 2007 5, Class A4 5,450 %, due 8/12/2048 *	158	0,02
613	HarborView Mortgage Loan Trust, Series 2005 9, Class B1, 2.645 % due 4/25/2035 *	511	0,07
2.526	Motel 6 Trust 2017-MTL6, Series 2017 USA, Class F, 144A, 6,445 %, due 8/15/2034 *	2.548	0,35
2.800	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 Ruhm, Klasse D, 144A, 4,544 %, fällig 8/5/2024 * ∞	2.751	0,37
2.450	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 Ruhm, Klasse E, 144A, 4,544 %, fällig 8/5/2024 * ∞	2.225	0,30
750	BX Trust 2015-4R, Series 2015 IMC, Class G, 144A, 2,231 %, due 3/26/2047	569	0,08
1.991	Nomura Reverbriefung RAAC Trust, Series 2015 4R, Class 2A2, 144A * 2,406 %, due 10/26/2036 *	1.720	0,23
3.980	Radnor Re 2018-1 Ltd, Series 2018 3A, Class M2, 144A, 144A 4,845 %, due 3/25/2028 *	4.005	0,54
260	Rosslyn Portfolio Trust BX Trust 2017-ROSS, Series 2017 IMC, Class G, 144A, 5,945 %, due 6/15/2033 *	258	0,04
5.365	12.2 Kreditrisiko Vertrauen Übertragen Serie 2017-1, Series 2017 3A, Class M1, 144A, 144A 4,000 %, due 1/25/2056 *	5.455	0,74
4.010	12.2 Kreditrisiko Vertrauen Übertragen Serie 2018-1, Serie 2018 1, Klasse M, 4,750 %, due 5/25/2057 *	4.072	0,55
3.000	Starwood Retail Property Vertrauen Sie auf 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Klasse C, 144A 4,695 %, due 11/15/2027 *	2.985	0,40
1.300	Starwood Retail Property Vertrauen Sie auf 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Klasse D, 144A 5,445 %, due 11/15/2027 *	1.169	0,16
1.160	Starwood Retail Property Vertrauen Sie auf 2014-STAR, Series 2014 USA, Class E, 144A, 6,345 %, due 11/15/2027 *	964	0,13
2.708	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Klasse D, 144A 4,223 %, due 11/11/2034 *	2.716	0,37
1.290	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Serie 2007-C33, Series 2007 C33, Class A1, 144A, 5,844 %, due 2/15/2051 *	1.120	0,15
712	WaMu Hypothekenpass-Über Zertifikate Serie 2005-AR17 Trust, LDP 12. Series 2005 AR17. Klasse A1C3, 2,625 %, due 12/25/2045 *	525	0,07
2.200	WaMu Hypothekenpass-Über Zertifikate Serie 2006-AR13 Trust, Series 2006 AR13, Class A1, 2A, 2,641 %, due 10/25/2046 *	2.137	0,29
878	WaMu Hypothekenpass-Über Zertifikate Serie 2006-AR3 Trust, Series 2006 AR3, Class A1B, 144A, 3,481 %, due 2/25/2046 *	849	0,11
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 93.814)		94.541	12,80
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 46,90 % (28. Februar 2019 46,62 %)			
Argentinien – 0,61 % (28. Februar 2017: 0,72 %)			
2.260	Transportadora de Gas del Rexel SA, 144A 6,750 %, due 5/2/2025	1.695	0,23
3.030	YPF SA, 8,500 %, due 3/23/2021	2.338	0,32
580	Rexel SA, 144A 8,500 %, due 3/23/2021	447	0,06
		4.480	0,61
Australien – 0,04 % (28. Februar 2019: 0,04 %)			
250	BHP Billiton Finance USA Ltd, 144A, 6,750 %, due 10/19/2075 *	293	0,04
Belgien – 1,10 % (28. Februar 2019: 0,67 %)			
3.090	Anheuser-Busch InBev NV Weltweit Inc., 5,550 %, due 1/23/2049	4.065	0,55
250	Anheuser-Busch InBev NV Weltweit Inc., 5,800 %, due 1/23/2059	341	0,04

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
EUR 3.200	CDON Group AB 4,750 %, Perpetual *	3.746	0,51
		8.152	1,10
Brasilien – 2,20 % (28. Februar 2019: 2,41 %)			
2.060	Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 4,500 %, due 1/10/2028	2.064	0,28
4.570	Petrobras Global Finance BV, 5,299 %, due 1/27/2025	4.953	0,67
1.800	Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, due 2/1/2029	1.954	0,26
1.690	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, due 6/5/2115	1.891	0,26
650	Suzano Austria GmbH, 5,750 %, due 7/14/2026	727	0,10
2.160	Suzano Austria GmbH, 6,000 %, due 1/15/2029	2.400	0,32
980	Vale Overseas Ltd, 6,250 %, due 8/10/2026	1.134	0,15
910	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, due 11/10/2039	1.152	0,16
		16.275	2,20
Kanada – 1,96 % (28. Februar 2019: 1,87 %)			
3.000	1011778 v. Chr. ULC / Neu GTL Trade Finance Inc, 144A, 4,625 %, due 1/15/2022	3.019	0,41
600	Barrick North America Finance LLC, 5,750 %, due 5/1/2043	808	0,11
GBP 290	Entertainment One Ltd, 4,625 %, due 7/15/2026	385	0,05
110	GFL Environmental Inc, 144A, 5,625 %, due 5/1/2022	112	0,02
1.190	GFL Environmental Inc, 144A, 5,375 %, due 3/1/2023	1.202	0,16
770	GFL Environmental Inc, 144A, 8,500 %, due 5/1/2027	845	0,11
2.644	Hudbay Minerals Inc, 144A 7,625 %, due 1/15/2025	2.697	0,37
4.030	MEG Energy Corp, 144A, 7,000 %, due 3/31/2024	3.854	0,52
410	Fly Leasing Ltd, 6,000 %, due 8/15/2040	453	0,06
1.060	Teck Resources Ltd, 5.400 %, due 2/1/2043	1.125	0,15
		14.500	1,96
Kaimaninseln – 0,40 % (28. Februar 2018: 0,00 %)			
2.960	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, due 9/15/2024	2.953	0,40
Chile – 0,24 % (28. Februar 2019: 0,24 %)			
1.730	Itau CorpBanca, 3,875 %, due 9/22/2019	1.731	0,24
China – 0,26 % (28. Februar 2019: 0,19 %)			
1.350	Country Garden Holdings Co Ltd 7,250 %, due 4/4/2021	1.355	0,18
550	Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, fällig am 12.11.2023	595	0,08
		1.950	0,26
Kolumbien – 0,31 % (28. Februar 2019: 0,12 %)			
870	Millicom International Cellular SA, 144A, 6,625 %, due 10/15/2026	949	0,13
1.220	Millicom International Cellular SA, 144A, 6,250 %, due 3/25/2029	1.330	0,18
		2.279	0,31
Denmark – 0,31 % (28. Februar 2017: 0,31 %)			
410	Shinhan Bank, 144A, 5,000 %, due 4/8/2017	433	0,06
450	Shinhan Bank, 144A, 5,375 %, due 4/8/2017	497	0,07
EUR 1.200	Danske Bank A/S 5,750 %, Perpetual *	1.346	0,18
		2.276	0,31
Frankreich – 1,36 % (28. Februar 2017: 1,61 %)			
5.330	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, due 5/1/2026	5.703	0,77
400	BNP Paribas SA, 4,625 %, due 3/13/2027	438	0,06
EUR 1.070	Credit Agricole SA, 6,500 %, Perpetual *	1.273	0,17
1.300	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetual * 644	1.520	0,21
930	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, due 9/17/2044	1.120	0,15
		10.054	1,36
Deutschland – 0,27 % (28. Februar 2017: 0,13 %)			
1.402	Mondelez International Inc, 6,500 %, due 2/1/2024	1.449	0,20
EUR 270	Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, due 9/30/2025	305	0,04
210	ZF Nordamerika Capital Inc, 144A, 4,750 %, due 4/29/2025	221	0,03
		1.975	0,27
Indien – 0,20 % (28. Februar 2017: 0,20 %)			
1.390	ICICI Bank Ltd, ADR Kong, 5,750 %, due 11/16/2020	1.440	0,20
Indonesien – 0,30 % (28. Februar 2017: 0,27 %)			
2.040	In Den Ländern PT, 144A, 4,125 %, due 5/15/2027	2.185	0,30
Irland – 0,46 % (28. Februar 2017: 0,45 %)			
690	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 5,000 %, due 10/1/2021	724	0,10
330	Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 5,125 %, due 10/1/2023	351	0,05
1.470	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,250 %, due 8/15/2022	1.556	0,21
730	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 4,500 %, due 3/15/2023	757	0,10
		3.388	0,46
Israel – 0,20 % (28. Februar 2017: 0,20 %)			
1.650	Teva Pharmaceutical NRG REMA LLC, Series C, 0,250 %, due 2/1/2026	1.507	0,20
Italien – 1,27 % (28. Februar 2017: 1,22 %)			
4.010	Intesa Sanpaolo Spa, 144A 5,017 %, due 6/26/2024	4.113	0,56
1.300	Intesa Sanpaolo Spa, 144A 5,710 %, due 1/15/2026	1.373	0,18
2.110	Telecom Italia SpA/ Milano,144A, 5,303 %, due 5/30/2024	2.266	0,31
1.450	UniCredit SPA, 144A, 7,296 %, fällig am 2. April 2034 *	1.639	0,22
		9.391	1,27
Jersey – 0,02 % (28. Februar 2017: 0,01 %)			
EUR 100	LHC3 PLC 4,125 %, due 8/15/2024	114	0,02
Kasachstan – 0,63 % (28. Februar 2017: 0,58 %)			
2.070	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC, 144A, 4,750 %, due 4/19/2027	2.269	0,31
200	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC, 144A, 6,375 %, due 10/24/2048	253	0,03
2.040	KazTransGas JSC, 4,375 %, due 9/26/2027	2.155	0,29
		4.677	0,63
Luxemburg – 0,38 % (28. Februar 2017: 0,56 %)			
1.740	Altice Luxembourg SA, 144A, 10,500 %, due 5/15/2027	1.896	0,26
532	ARD Securities Finance SARL, 144A, 8,750 %, due 1/31/2023	554	0,07
EUR 300	Aguila 2 SA, 6.875 % due 6/15/2022	335	0,05
		2.785	0,38
Sambia – 0,26 % (28. February 2019: 0,14 %)			
260	MGM China Holdings Ltd, 144A, 5,375 %, due 5/15/2024	268	0,04
510	MGM China Holdings Ltd, 144A, 5,875 %, due 5/15/2026	532	0,07
1.000	Sands China Ltd 5,125 %, due 8/8/2025	1.110	0,15
		1.910	0,26
Mexiko – 0,34 % (28. Februar 2017: 0,34 %)			
200	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman, 144 A, 6,875 %, zeitlich unbegrenzt *	199	0,03
2.330	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144 A, 7,625 %, zeitlich unbegrenzt *	2.339	0,31
		2.538	0,34
Niederlande – 0,96 % (28. Februar 2017: 0,89 %)			
390	Cooperatieve Rabobank UA, 3,750 %, due 7/21/2026	409	0,06
EUR 3.200	Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, Perpetual *	3.881	0,53
310	Trivium Packaging Finance BV, 144A, 8,500 %, due 8/15/2027	334	0,04
230	UPC Holding BV, 144A, 5,500 %, due 1/15/2028	240	0,03
2.160	UPCB Finance IV Ltd, 144A 5,375 %, due 1/15/2025	2.234	0,30
		7.098	0,96
Russland – 0,52 % (28. Februar 2017: 0,48 %)			
1.730	Gazprom OAO Über Gaz Capital SA, 144A, 4,950 %, due 3/23/2027	1.868	0,25
1.820	Lukoil International Finance BV, 144A, 4,750 %, due 11/2/2026	1.986	0,27
		3.854	0,52
Singapur – 0,10 % (28. Februar 2017: 0,10 %)			
710	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, due 6/19/2024	759	0,10
Südafrika – 0,33 % (28. Februar 2017: 0,29 %)			
210	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,000 %, due 9/11/2027	217	0,03
1.930	Myriad International Holdings BV, 4.850 % due 7/6/2027	2.195	0,30
		2.412	0,33
Spanien – 0,32 % (28. Februar 2017: 0,41 %)			
EUR 1.600	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 5,875 %, Perpetual *	1.835	0,25
150	Telefonica Emisiones SAU, 4,103 %, due 3/8/2027	164	0,02
EUR 100	Imperial Brands Finance Plc, 5,000 %, due 9/15/2024	113	0,02
EUR 230	Tendam Brands SAU, 5,250 %, fällig am 15.09.2024 *	254	0,03
		2.366	0,32

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Schweiz – 0,73 % (28. Februar 2017: 0,70 %)			
200	Credit Suisse Group AG 7,500 %, Perpetual *	221	0,03
200	Credit Suisse Group AG 7,250 %, Perpetual *	213	0,03
670	Credit Suisse Group AG 7,500 %, Perpetual *	714	0,10
2.230	Glencore Funding LLC, 144A 4,000 %, due 4/16/2025	2.317	0,31
310	Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, due 3/27/2027	321	0,04
1.540	UBS Group Funding Switzerland AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	1.634	0,22
		5.420	0,73
Vereinigte Arabische Emirate - 1,02 % 28. Februar 2019 0,98 %)			
3.250	CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, due 11/15/2023	3.437	0,47
2.010	Plc, 144A, 5,625 %, due 9/25/2048	2.401	0,32
1.870	Regal Drilling Holdings Ltd, 144A, 8,250 %, due 2/15/2025	1.674	0,23
		7.512	1,02
Großbritannien – 2,27 % (28. Februar 2019: 2,44 %)			
GBP 350	Anglian Water Osprey Finanzierung Plc, 5,000 %, due 4/30/2023	432	0,06
320	Ashtead Capital Inc., 144A 5,250 %, due 8/1/2026	343	0,05
340	Ashtead Capital Inc., 144A 4,375 %, due 8/15/2027	350	0,05
900	OTP Bank Plc 7,625 %, due 11/21/2022	993	0,13
740	Barclays Plc 4,972 %, due 5/16/2029 *	813	0,11
540	Barclays Plc 7,750 %, Perpetual *	552	0,07
1.550	Barclays Plc 8,000 %, Perpetual *	1.613	0,22
GBP 470	CPUK Finance Ltd, 7,239 %, due 2/28/2024	700	0,09
980	HSBC Holdings Plc 4,583 %, due 6/19/2029 *	1.096	0,15
EUR 1.500	HSBC Holdings Plc 5,250 %, Perpetual *	1.758	0,24
580	HSBC Holdings Plc 6,250 %, Perpetual *	593	0,08
1.680	HSBC Holdings Plc 6,500 %, Perpetual *	1.728	0,23
GBP 260	Jerrold Finco Plc, 6,125 %, due 1/15/2024	320	0,04
1.090	Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, due 3/24/2026	1.151	0,16
200	RSA Insurance Group Plc, 7,500 %, Perpetual	207	0,03
EUR 2.100	RSA Insurance Group Plc, 6,375 %, Perpetual	2.351	0,32
750	Royal Bank of Scotland Group Plc, 8,625 %, Perpetual * 5,125 %, due 5/28/2024	794	0,11
GBP 340	IG Group Holdings Plc 7,375 %, Perpetual *	437	0,06
440	Vodafone Group Plc, 4.375 % due 5/30/2028	494	0,07
		16.725	2,27
USA – 26,98 % (28. Februar 2019: 27,51 %)			
1.080	Fortschrittliche Mikrogeräte Inc 7,500 %, due 8/15/2022	1.222	0,17
2.880	Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, due 5/15/2028	3.002	0,41
1.610	Allied Universal Holdco TMX Finance LLC / TitleMax Finance Corp, 144A, 6,625 %, due 7/15/2026	1.715	0,23
240	Altria Group Inc 4,400 %, due 2/14/2026	263	0,04
780	Altria Group Inc 4,800 %, due 2/14/2029	882	0,12
157	American Airlines 2013-2 Class B Pass Through Vertrauen, 144A, 5,600 %, due 7/15/2020	160	0,02
1.300	American Axle & Fertigungs- Inc., 6,500 %, due 4/1/2027	1.198	0,16
884	American Media LLC, 10,500 %, due 12/31/2026	933	0,13
2.136	American Media LLC, 144A 10,500 %, due 12/31/2026	2.253	0,30
300	Anadarko Petroleum Corp 6,600 %, due 3/15/2046	397	0,05
910	ASP AMC Merger Sub Inc., 144A 8,000 %, due 5/15/2025	617	0,08
900	Bank of America Corp 4,000 %, due 1/22/2025	962	0,13
570	Bank of America Corp, 4,250 %, due 10/22/2026	623	0,08
1.390	Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, due 4/1/2026	1.578	0,21
1.160	Bausch Health Americas Inc, 144A, 8,500 %, due 1/31/2027	1.290	0,17
270	Bausch Health Cos Inc., 144A 7,000 %, due 3/15/2024	286	0,04
828	Becton Dickinson und Co, 3,700 %, due 6/6/2027	888	0,12
2.160	Berry Petroleum Co 144A 7,000 %, due 2/15/2026	1.993	0,27
700	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, due 7/15/2026	693	0,09
380	Boeing Co/The, 2,700 %, due 2/1/2027	391	0,05
910	Boeing Co/The, 3,250 %, due 2/1/2035	968	0,13
740	Bristol-Myers Squibb Co 144A 4,250 %, due 10/26/2049	889	0,12
10	CalAtlantic Group Inc/Old, 5,250 %, due 6/1/2026	10	-
1.040	Carriage Services Inc., 144A 6,625 %, due 6/1/2026	1.069	0,14
490	CCO HOLDINGS LLC/CCO Ares Capital Corp 5,250 %, due 9/30/2022	496	0,07
1.530	CCO HOLDINGS LLC/CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,375 %, due 5/1/2025	1.593	0,22
1.180	CCO HOLDINGS LLC/CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, due 5/1/2027	1.251	0,17
1.330	CCO HOLDINGS LLC/CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,000 %, due 2/1/2028	1.400	0,19
1.080	CDK Global Inc, 144A, 5,250 %, due 5/15/2029	1.116	0,15
120	Celgene Corp 5,000 %, due 8/15/2045	152	0,02
450	Centene-Corp, 6,125 %, due 2/15/2024	472	0,06
1.250	Centene Corp, 144A, 5,375 %, due 6/1/2026	1.339	0,18
510	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Betriebskapital, 4,200 %, due 3/15/2028	543	0,07
350	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Betriebskapital, 6,384 %, due 10/23/2035	428	0,06
310	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Betriebskapital, 5,375 %, due 4/1/2038	350	0,05
1.010	Gibson Energy Inc 4,250 %, due 3/15/2045	785	0,11
250	Chesapeake Energy Corp, 5,500 %, due 9/15/2026	158	0,02
3.400	Chesapeake Energy Corp, 8,000 %, due 6/15/2027	2.474	0,33
1.230	Citigroup Inc 4,450 %, due 9/29/2027	1.354	0,18
618	Cleaver-Brooks Inc, 144A, 7,875 %, due 3/1/2023	570	0,08
960	Cogent Communications Gruppe Inc, 144A, 5,375 %, due 3/1/2022	1.001	0,14
770	Comcast Corp 4,250 %, due 10/15/2030	895	0,12
1.790	Comcast Corp 4,700 %, due 10/15/2048	2.246	0,30
810	CommScope Inc, 144A, 8,250 %, due 3/1/2027	797	0,11
370	CommScope Technologies LLC, 144A, 5,000 %, due 3/15/2027	311	0,04
2.140	CoreCivic Inc, 4,625 %, due 5/1/2023	2.076	0,28
2.050	Covey Park Energy LLC / Covey Park Finance Corp, 144A, 7,500 %, due 5/15/2025	1.466	0,20
4.490	CSC HOLDINGS LLC, 144A, 6,500 %, due 2/1/2029	5.040	0,68
2.560	CRC Health Corp 4,780 %, due 3/25/2038	2.868	0,39
130	DCP Midstream In Betrieb LP, 4,950 %, due 4/1/2022	135	0,02
600	DCP Midstream In Betrieb LP, 144A, 6,750 %, due 9/15/2037	633	0,09
580	Devon Energy Corp 5,000 %, due 6/15/2045	683	0,09
710	Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co, 144A, 5,375 %, due 8/15/2026	747	0,10
1.830	Gibson Energy Inc 4,750 %, due 11/1/2024	1.892	0,26
980	Gibson Energy Inc 5,375 %, due 5/31/2025	1.031	0,14
3.970	Gericht DBS Corp, 7,750 %, due 7/1/2026	3.910	0,53
1.400	Dish Network Corp, 3,375 %, due 8/15/2026	1.292	0,17
260	Endeavour Energy Ressourcen LP/EER Finance Inc, 144A, 5,500 %, due 1/30/2026	271	0,04
130	Endeavour Energy Ressourcen LP/EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, due 1/30/2028	137	0,02
750	Absaugöl Und Gas Inc., 144A 7,375 %, due 5/15/2024	566	0,08
600	Absaugöl Und Gas Inc., 144A 5,625 %, due 2/1/2026	399	0,05
1.500	FirstEnergy Corp, Serie B, 3,900 %, due 7/15/2027	1.614	0,22
1.640	Fünf Punkte Zusammenarbeit LP/Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, due 11/15/2025	1.649	0,22
590	Fox Corp, 144A, 4,709 %, due 1/25/2029	683	0,09
310	Fox Corp, 144A, 5,476 %, due 1/25/2039	389	0,05

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
3.200	Freeport-Mc Moran Inc., 5,450 %, due 3/15/2043	2.936	0,40
2.820	General Electric Co 6,875 %, due 1/10/2039	3.598	0,49
520	General Motors Co 6,250 %, due 10/2/2043	585	0,08
1.050	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 5,625 %, due 6/15/2024	1.008	0,14
965	Geo Group Inc/The, 5,875 %, due 1/15/2022	940	0,13
320	CIT Group Inc, 5,875 %, due 10/15/2024	283	0,04
1.437	Geo Group Inc/The, 6,000 %, due 4/15/2026	1.250	0,17
680	GLP CAPITAL LP/GLP Finanzierung II Inc., 5,750 %, due 6/1/2028	775	0,10
360	Goldman Sachs Group Inc/The, Der, 3,500 %, due 11/16/2026	377	0,05
580	Goldman Sachs Group Inc/The, Der, 5,150 %, due 5/22/2045	705	0,10
1.000	Hanesbrands Inc, 144A, 4,625 %, due 5/15/2024	1.051	0,14
1.400	Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, due 5/15/2026	1.483	0,20
1.290	Harsco Corp, 144A, 5,750 %, due 7/31/2027	1.340	0,18
600	BCE Inc 5,375 %, due 2/1/2025	668	0,09
2.900	BCE Inc 5,625 %, due 9/1/2028	3.307	0,45
2.450	BCE Inc 5,500 %, due 6/15/2047	2.818	0,38
50	Hilton Domestic Operating Co Inc., 5,125 %, due 5/1/2026	53	0,01
600	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,625 %, due 4/1/2025	621	0,08
1.020	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875 %, due 10/2/2023	1.077	0,15
1.070	Immucor Inc, 144A, 11,125 %, due 2/15/2022	1.089	0,15
580	Indigo Natürliche Ressourcen LLC, 144A, 6,875 %, due 2/15/2026	481	0,06
380	J2 Cloud Services LLC/j2 Global Co-Obligor Inc, 144A 6,000 %, due 7/15/2025	401	0,05
1.670	Jack Ohio Finance LLC / Jack Ohio Finance 1 Corp, 144A, 10,250 %, due 11/15/2022	1.776	0,24
1.020	JB Poindexter & Co Inc, 144A 7,125 %, due 4/15/2026	1.048	0,14
460	JPMorgan Chase & Co 3,625 %, due 3/6/2019	489	0,07
640	Kraft Heinz Foods Co, 3,950 %, due 7/15/2025	665	0,09
890	Brands Inc 5,625 %, due 10/15/2023	939	0,13
3.250	Brands Inc 5,250 %, due 2/1/2028	2.974	0,40
640	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,625 %, due 11/1/2024	672	0,09
1.320	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,875 %, due 11/1/2026	1.384	0,19
1.100	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, due 8/8/2024	1.124	0,15
1.010	Lennar Corp, 4,500 %, due 4/30/2024	1.077	0,15
350	Lennar Corp, 4,750 %, due 11/29/2027	382	0,05
320	Levi Strauß & Co, 5,000 %, due 5/1/2025	334	0,05
1.950	Liberty Media Corp, 144A, 2,125 %, due 3/31/2048	2.000	0,27
1.150	Magellan Health Inc., 4,900 %, due 9/22/2024	1.154	0,16
1.430	Vergleichsgruppe Inc, 144A, 5,000 %, due 12/15/2027	1.509	0,20
720	MGM Growth Properties Betriebspartnerschaft LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 4,500 %, due 9/1/2026	758	0,10
3.260	Targa Resources Corp 8,875 %, due 7/15/2023	2.461	0,33
1.660	MPT-Betrieb Partnerschaft LP/MPT Finanzabteilung, 5,000 %, due 10/15/2027	1.776	0,24
550	Navios Maritime Acquisition Corp/Navios Acquisition Finance US Inc, 144A, 8,125 %, due 11/15/2021	450	0,06
2.670	NCL Corp Ltd, 144A 4,750 %, due 12/15/2021	2.717	0,37
1.130	Netflix Inc., 5,875 %, due 11/15/2028	1.267	0,17
1.530	Netflix Inc, 144A, 6,375 %, due 5/15/2029	1.767	0,24
2.820	NGPL PIPECO LLC, 144A, 7,768 %, due 12/15/2037	3.691	0,50
1.460	Northern Oil and Gas Inc., 8,500 %, due 5/15/2023	1.510	0,20
1.890	Nordwest-Akquisitionen Ulc/Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, due 11/1/2022	1.186	0,16
780	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, due 3/15/2022	729	0,10
420	Occidental Petroleum Corp., 2,900 %, due 8/15/2024	424	0,06
440	Occidental Petroleum Corp., 3,200 %, due 8/15/2026	445	0,06
370	Olin Corp, 5,000 %, due 2/1/2030	371	0,05
1.300	Pactiv LLC, 8,375 %, due 4/15/2027	1.401	0,19
810	Park-Ohio Industries Inc., 6,625 %, due 4/15/2027	782	0,11
3.400	PetSmart Inc, 144A, 7,125 %, due 3/15/2023	3.179	0,43
1.000	Polaris Intermediate Corp, 144A 8,500 %, due 12/1/2022	845	0,11
792	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 9,250 %, due 5/15/2023	834	0,11
300	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,250 %, due 4/15/2024	311	0,04
990	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,750 %, due 4/15/2026	1.035	0,14
3.230	Quicken Loans Inc, 144A, 5,750 %, due 5/1/2025	3.383	0,46
600	Targa Resources Corp 5,875 %, due 7/1/2022	578	0,08
1.080	Targa Resources Corp 5,000 %, due 3/15/2023	959	0,13
980	Targa Resources Corp 4,875 %, due 5/15/2025	809	0,11
1.190	Resolute Forest Products Inc 5,875 %, due 5/15/2023	1.190	0,16
990	Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 7,500 %, due 7/15/2038	1.127	0,15
1.620	Sally Holdings LLC/Sally Kapitalrechnung, 5,625 %, due 12/1/2025	1.628	0,22
796	Seagate HDD Cayman, 4,750 %, due 6/1/2023	832	0,11
1.240	Service Corp International/ (USA) 7,500 %, due 4/1/2027	1.494	0,20
500	ServiceMaster Co LLC/Der, 7,450 %, due 8/15/2027	557	0,08
677	Silversea Cruise Finance Ltd, 144A, 7,250 %, due 2/1/2025	729	0,10
120	Speedway Motorsports Inc 5,125 %, due 2/1/2023	122	0,02
400	Ares Capital Corp 6,875 %, due 11/15/2028	445	0,06
3.300	Ares Capital Corp 8,750 %, due 3/15/2032	4.141	0,56
170	Sprint Communications Inc 11,500 %, due 11/15/2021	200	0,03
350	Sprint Corp, 7,250 %, due 9/15/2021	377	0,05
100	Sprint Corp, 7,875 %, due 9/15/2023	113	0,02
170	Sprint Corp, 7,125 %, due 6/15/2024	188	0,03
660	Sprint Corp, 7,625 %, due 2/15/2025	740	0,10
1.670	Standardbranchen, Inc./NJ, 144A 6,000 %, due 10/15/2025	1.764	0,24
480	Standardbranchen, Inc./NJ, 144A 4,750 %, due 1/15/2028	484	0,07
1.200	Talen Energy Supply LLC, 144A 10,500 %, due 1/15/2026	1.094	0,15
120	Targa Resources Corp LP/Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 6,500 %, due 7/15/2027	131	0,02
1.350	Targa Resources Corp LP/Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 6,875 %, due 1/15/2029	1.495	0,20
1.390	Tenet Healthcare Corp, 8,125 %, due 4/1/2022	1.503	0,20
850	T-Mobile USA Inc, 4,750 %, due 2/1/2028 ∞	-	-
1.710	T-Mobile USA Inc, 4,750 %, due 2/1/2028	1.806	0,24
990	Union Pacific Corp 4,500 %, due 9/10/2048	1.207	0,16
2.500	United Rentals North Amerika Inc., 4,625 %, due 7/15/2023	2.564	0,35
1.110	United Rentals North Amerika Inc., 6,500 %, due 12/15/2026	1.211	0,16
730	United Rentals North Amerika Inc., 5,500 %, due 5/15/2027	786	0,11
510	United Rentals North Amerika Inc., 4,875 %, due 1/15/2028	537	0,07
210	United Rentals North Amerika Inc., 5,250 %, due 1/15/2030	225	0,03
2.290	Univision Communications Inc, 144A, 5,125 %, due 5/15/2023	2.273	0,31
480	Verizon Communications Inc 4,522 %, due 9/15/2048	578	0,08
1.250	Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, due 9/15/2027	1.300	0,18
2.280	Vishay Intertechnology Inc 2,250 %, due 6/15/2025	2.122	0,29
2.290	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, due 2/15/2028	2.359	0,32
1.360	WEIGHT WATCHERS International Inc, 144A, 8,625 %, due 12/1/2025	1.370	0,19
430	Wells Fargo & Co 4,650 %, due 11/4/2044	517	0,07

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
390	Western Midstream Betrieb LP, 5,450 %, due 4/1/2044	363	0,05
446	Williams Cos Inc/The 8,750 %, due 3/15/2032	651	0,09
1.960	Windstream Services LLC / Windstream Finance Corp, 10,500 %, due 6/30/2024 †	1.225	0,17
1.120	CVR Energy Inc 8,250 %, due 8/1/2023	1.252	0,17
290	CVR Energy Inc 5,750 %, due 6/1/2026	302	0,04
4.695	Xpo CNW Inc., 6,700 %, due 5/1/2034	4.625	0,63
2.000	Xpo Logistics Inc, 144A, 6,125 %, due 9/1/2023	2.073	0,28
		199.235	26,98
Sambia – 0,55 % (28. February 2019: 0,46 %)			
4.090	Erste Quantum-Mineralien Ltd, 144A, 7,250 %, due 4/1/2023	3.865	0,52
230	Erste Quantum-Mineralien Ltd, 144A, 7,500 %, due 4/1/2025	212	0,03
		4.077	0,55
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 332.962)		346.311	46,90
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 19,93 % 28. Februar 2019 19,33 %)			
Argentinien – 1,02 % (28. Februar 2019: 2,31 %)			
ARS 29.670	Argentina POM Politica Monetaria, Serie POM, 66,777 %, due 6/21/2020 *	170	0,02
1.480	Argentinische Republik Internationale Staatsanleihe, 4,625 %, due 1/11/2023	586	0,08
4.170	Internationale Anleihe Der Regierung Der Argentinischen Republik, 7,500 %, due 4/22/2026	1.632	0,22
1.090	Argentinische Republik Internationale Staatsanleihe, 7,125 %, due 7/6/2036	411	0,06
ARS 72.790	Bonos de la Nacion Argentinien con Ajuste por CER, 4,000 %, due 3/6/2020	908	0,12
290	Provincia de Buenos Aires/ Peru Government Bond, 144A, 9,950 %, due 6/9/2021	106	0,02
1.190	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 9,950 %, fällig am 09.06.2021	434	0,06
5.190	Provincia de Buenos Aires/ Peru Government Bond, 144A, 6,500 %, due 2/15/2023	1.687	0,23
1.200	Provincia de Buenos Aires/ Peru Government Bond, 144A, 9,125 %, due 3/16/2024	396	0,05
580	Provincia de Buenos Aires/ Peru Government Bond, 144A, 7,875 %, due 6/15/2027	194	0,03
2.090	Provincia de Cordoba, 144A 7,450 %, due 9/1/2024	982	0,13
		7.506	1,02
Brasilien – 1,74 % (28. Februar 2019: 1,75 %)			
BRL 18.464	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series Ob, 10,000 %, due 1/1/2021	4.698	0,64
BRL 13.935	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series Ob, 10,000 %, due 1/1/2027	3.859	0,52
4.060	Brasilianische Regierung Internationale Anleihe, 5,000 %, due 1/27/2045	4.327	0,58
		12.884	1,74
Ecuador – 0,47 % (28. Februar 2017: 0,47 %)			
310	Regierung Ecuadors Internationale Anleihe, 7,950 %, due 6/20/2024	313	0,04
2.480	Regierung Ecuadors Internationale Anleihe, 144A, 9,625 %, due 6/2/2027	2.551	0,35
540	Regierung Ecuadors Internationale Anleihe, 144A, 10,750 %, due 1/31/2029	583	0,08
		3.447	0,47
Ägypten – 1,21 % (28. Februar 2017: 0,40 %)			
1.090	Regierung Ägyptens Internationale Anleihe, 144A, 7,600 %, due 3/1/2029	1.179	0,16
EGP 101.450	Schatzanweisungen Ägyptens, Serie 273D, zero coupon, due 2/11/2020	5.753	0,78
EGP 36.000	Schatzanweisungen Ägyptens, Call 120,50, due 3/17/2020	2.013	0,27
		8.945	1,21
Ghana – 0,65 % (28. Februar 2017: 0,48 %)			
1.510	Regierung Ghanas Internationale Anleihe, 8,125 %, due 1/18/2026	1.602	0,22
2.000	Regierung Ghanas Internationale Anleihe, 144A, 7,625 %, due 5/16/2029	1.981	0,27
1.230	Regierung Ghanas Internationale Anleihe, 144A, 8,125 %, due 3/26/2032	1.206	0,16
		4.789	0,65
Indonesien – 3,06 % (28. Februar 2017: 3,25 %)			
360	Regierung Indonesiens Internationale Anleihe, 5,875 %, due 1/15/2024	408	0,05
1.590	Regierung Indonesiens Internationale Anleihe, 6,625 %, due 2/17/2037	2.222	0,30
3.490	Regierung Indonesiens Internationale Anleihe, 5,250 %, due 1/17/2042	4.325	0,59
IDR 760.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR61, 7,000 %, due 5/15/2022	54	0,01
IDR 37.154.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR56, 8,375 %, due 9/15/2026	2.783	0,38
IDR 183.008.000	Indonesien-Schatzanleihe, Serie FR59, 7,000 %, due 5/15/2027	12.715	1,72
IDR 721.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR68, 8,375 %, due 3/15/2034	54	0,01
		22.561	3,06
Japan – 0,12 % (28. Februar 2017: 0,12 %)			
JPY 92.200	CPI der japanischen Regierung Verknüpfte Anleihe, Serie 21, 0,100 %, due 3/10/2026	911	0,12
Kasachstan – 0,27 % (28. Februar 2017: 0,26 %)			
1.760	Regierung Kasachstans Internationale Anleihe, 5,125 %, due 7/21/2025	2.007	0,27
Kenia – 0,28 % (28. Februar 2017: 0,00 %)			
1.930	Kenianische Regierung Internationale Anleihe, 144A, 7,000 %, due 5/22/2027	2.038	0,28
Kuwait – 0,31 % (28. Februar 2017: 0,29 %)			
2.090	Kuwait International Peru Government Bond, 144A, 3,500 %, due 3/20/2027	2.298	0,31
Mexiko – 0,53 % (28. Februar 2017: 0,47 %)			
470	Regierung Mexikos Internationale Anleihe, 3,600 %, due 1/30/2025	491	0,07
3.100	Regierung Mexikos Internationale Anleihe, 4,750 %, due 3/8/2044	3.432	0,46
		3.923	0,53
Sambia – 0,59 % (28. February 2019: 0,27 %)			
1.800	Regierung Von Katar Internationale Anleihe, 144A, 5,103 %, due 4/23/2048	2.402	0,33
1.500	Regierung Von Katar Internationale Anleihe, 144A, 4,817 %, due 3/14/2049	1.934	0,26
		4.336	0,59
Russland – 1,83 % (28. Februar 2017: 1,62 %)			
RUB 895.489	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050 %, due 1/19/2028	13.544	1,83
Senegal – 0,26 % (28. Februar 2017: 0,42 %)			
1.970	Senegal Government International Bond, 144A, 6,250 %, due 5/23/2033	1.955	0,26
Vereinigte Arabische Emirate - 0,40 % 28. Februar 2019 0,32 %)			
2.350	Regierung Abu Dhabi Internationale Anleihe, 144A, 4,125 %, due 10/11/2047	2.928	0,40
USA – 7,19 % (28. Februar 2017: 6,90 %)			
12.720	United States Treasury Bill, zero coupon due 2/6/2020	12.619	1,71
40.230	US-Dollar Note/Bond, 1,625 %, due 3/15/2020	40.177	5,44
130	US-Dollar Note/Bond, 1,750 %, due 7/31/2024	132	0,02
150	US-Dollar Note/Bond, 1,625 %, due 8/15/2029	152	0,02
		53.080	7,19
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 159.467)		147.152	19,93
Schuldscheindarlehen – 9,71 % (28. Februar 2017: 9,32 %)			
1.286	1011778 V. CHR. ULC, 4,484 %, due 2/16/2024 *	1.286	0,18
457	Academy Ltd, 6,230 %, due 7/2/2022 *	307	0,04
442	Advantage Sales & Marketing Inc., 5,580 %, due 7/25/2021 *	411	0,06
535	Air Medical Group JX Holdings Inc 5,432 %, due 4/28/2022 *	505	0,07
1.171	Albertson's LLC, 5,234 %, due 11/17/2025 *	1.176	0,16
65	Albertson's LLC, 5,234 %, due 8/7/2026 *	65	0,01
70	Allied Universal Holdco LLC, 0,000 %, due 6/27/2026 *	70	0,01
710	Allied Universal Holdco LLC, 6,507 %, due 6/27/2026 *	710	0,10
505	Almonde Inc., 5,734 %, due 6/16/2024 *	489	0,07
940	Altra Industrielle Bewegung Corp., 4,234 %, due 10/1/2025 *	938	0,13
1.377	American Axle & Petsmart Inc, 4,520 %, due 4/6/2024 *	1.353	0,18
477	Ancestry.com Inc., 5,490 %, due 10/19/2023 *	475	0,06
1.147	AppLovin Corp, 5,734 %, due 8/15/2025 *	1.148	0,16
1.841	Asurion LLC, 5,234 %, due 11/3/2024 *	1.844	0,25
1.185	Avolon TLB-Kreditnehmer 1 U.S. LLC, 4,021 %, due 1/15/2025 *	1.189	0,16
992	Evraz Group SA, 7,234 %, due 9/25/2024	947	0,13
1.782	Joy Global Inc 4,451 %, due 10/1/2022 *	1.784	0,24
1.200	Beta Sub LLC, 6,729 %, due 5/24/2026 *	1.197	0,16
127	DISH DBS Corp, 4,392 %, due 9/15/2023	127	0,02

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Schuldscheindarlehen – (Fortsetzung)			
744	Brightview Landschaften LLC, 4,750 %, due 8/15/2025 *	746	0,10
40	Brookfield WEC Holdings Inc 5,734 %, due 8/1/2025 *	40	0,01
1.710	Caesars Resort Collection LLC, 4,984 %, due 12/22/2024 *	1.687	0,23
324	CBS Radio Inc., 4,991 %, due 11/17/2024 *	324	0,04
325	HCA Inc, 5,484 %, due 8/15/2026	316	0,04
1.432	CHANGE HEALTHCARE Holdings LLC, 4,734 %, due 3/1/2024 *	1.417	0,19
522	Citycenter Holdings LLC, 4,484 %, due 4/18/2024 *	523	0,07
1.022	CDON Group AB 4,984 %, due 11/8/2023 *	886	0,12
560	DCERT Buyer Inc., 0,000 %, due 8/8/2026 *	560	0,08
128	Dell International LLC, 4,240 %, fällig am 7. September 2023 *	128	0,02
339	Silgan Holdings Inc, 6,234 %, due 10/31/2024 *	339	0,05
130	First Eagle Holdings Inc., 5,080 %, due 12/1/2024 *	130	0,02
148	NBK SPC Ltd, 4,234 %, due 11/30/2023 *	148	0,02
1.230	Generac Power Systems Inc, 3,980 %, due 5/31/2023 *	1.233	0,17
1.318	Globales Tel'Link Corp., 6,484 %, due 11/29/2025 *	1.263	0,17
205	GlobalTranz Enterprises Inc 0,000 %, due 5/2/2026 *	197	0,03
795	GlobalTranz Enterprises Inc 7,182 %, due 5/2/2026 *	766	0,10
514	Golden Nugget Inc., 4,932 %, due 10/4/2023 *	514	0,07
1.614	IHeartCommunications Inc 6,230 %, due 5/1/2026 *	1.621	0,22
1.584	Intrawest Resorts Holdings Inc 5,234 %, due 7/31/2024 *	1.583	0,21
764	Tennet Holding BV, 4.734 % due 8/18/2022 *	761	0,10
181	Leslie's Poolmart Inc, 5,758 %, due 8/16/2023 *	170	0,02
1.670	GTL Trade Finance Inc, 4,484 %, due 2/22/2024 *	1.673	0,23
22	MA FinanceCo. LLC, 4,734 %, due 4/18/2024 *	22	-
1.630	McAfee LLC, 5,991 %, due 9/29/2024 *	1.633	0,22
1.120	Meredith Corp, 4,984 %, due 1/31/2025 *	1.123	0,15
1.112	MGM Growth Properties Betriebspartnerschaft, 4,234 %, due 3/19/2025 *	1.114	0,15
1.526	MPH Acquisition Holdings LLC, 5,080 %, due 6/7/2023 *	1.423	0,19
1.490	Panther BF Aggregator 2 LP, 5,734 %, due 3/18/2026 *	1.468	0,20
1.513	Party City Holdings Inc, 4,740 %, due 8/19/2022	1.497	0,20
310	Petco Animal Supplies Inc., 5,506 %, due 1/26/2023 *	225	0,03
881	PetSmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022 *	856	0,12
540	Phoenix Garant Inc., 6,744 %, due 3/5/2026 *	538	0,07
220	WINDSTREAM HOLDINGS INC 4,270 %, due 5/24/2024 *	220	0,03
1.502	Prime Security Services Kreditnehmer LLC, 4,984 %, due 5/2/2022 *	1.503	0,20
1.744	Waste Management Inc 5,830 %, due 7/1/2023 *	1.737	0,24
750	RegionalCare Hospital Partner Holding, 6,769 %, due 11/16/2025 *	745	0,10
1.641	Reynolds Group Holdings Inc 4,984 %, due 2/5/2023 *	1.642	0,22
136	RPI Finance Trust, 4,234 %, due 4/17/2023 *	137	0,02
1.692	Wissenschaftliche Spiele International Inc., 4,984 %, due 8/14/2024 *	1.675	0,23
150	Seattle SpinCo Inc., 4,734 %, due 4/18/2024 *	146	0,02
509	Securus Technologies Holdings LLC, 6,830 %, due 11/1/2024 *	458	0,06
995	Sedgwick Behauptet Management Services Inc., 5,484 %, fällig am 5. November 2025 *	968	0,13
136	ServiceMaster Co LLC/Der, 4,734 %, due 11/8/2023 *	137	0,02
654	Stars Group Holdings BV, 5,830 %, due 7/10/2025 *	656	0,09
1.157	JX Holdings Inc 5,990 %, due 2/1/2023 *	1.132	0,15
1.084	Trans Union LLC, 4,234 %, due 4/9/2023 *	1.087	0,15
1.050	Travelport Finance Luxemburg-Sarl, 7,541 %, due 3/18/2026 *	972	0,13
1.450	Capsugel Holdings U.S. Inc, 7,250 %, due 6/14/2026 *	1.391	0,19
1.793	UFC Holdings LLC, 5,490 %, due 4/29/2026 *	1.795	0,24
413	UIC Merger Sub Inc, 5,484 %, due 7/28/2024 *	399	0,05
1.750	Ultimate Software Group Inc 6,080 %, due 4/8/2026 *	1.757	0,24
1.243	Univision Communications Inc 4,984 %, due 3/15/2024 *	1.191	0,16
1.344	Valeant Pharmaceuticals International, 5,201 %, due 5/28/2025 *	1.348	0,18
985	Vantage Specialty Chemicals Inc 6,022 %, due 10/28/2024 *	946	0,13
1.300	Vici Properties 1 LLC, 4,272 %, due 12/22/2024 *	1.303	0,18
1.800	Virgin Media Bristol LLC, 4,695 %, due 1/31/2026 *	1.802	0,24
1.317	VVC Holding Corp, 6,701 %, due 2/11/2026 *	1.312	0,18
909	CIT Group Inc, 5,945 %, due 10/11/2025	898	0,12
170	Wink Holdco Inc., 5,234 %, due 12/1/2024 *	166	0,02
1.220	WP CityMD Bidco LLC, 6,706 %, due 8/6/2026 *	1.208	0,16
Loan Notes insgesamt (Anschaffungskosten USD 72.655)		71.676	9,71
Investmentfonds – 0,99 % (28. Februar 2017: 0,93 %)			
74	Legg Mason Global Funds plc Sps - Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund - LM-Klasse US-Dollar Distribution (M)	7.291	0,99
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 7.125)		7.291	0,99
Vorzugsaktien – 0,03 % (28. Februar 2019: 0,03 %)			
USA – 0,03 % (28. Februar 2019: 0,03 %)			
9	B. Riley Financial Inc. †	243	0,03
Vorzugsaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 234)		243	0,03
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 726.440)		727.195	98,48

Kontrakte (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Gekaufte Optionen – 0,24 % (28. Februar 2017: 0,02 %)			
-	S&P 500 E-MINI September 2019 Put 2.700,00, due 9/20/2019	35	-
-	S&P 500 E-MINI September 2019 Put 2.750,00, due 9/20/2019	67	0,01
-	S&P 500 E-MINI W3 November 2019 Put 2.850,00, due 11/15/2019	175	0,02
-	S&P 500 E-Mini W3 Oktober 2019 Put 2.600,00, due 10/18/2019	47	0,01
-	S&P 500 E-Mini W3 Oktober 2019 Put 2.750,00, due 10/18/2019	112	0,02
6.500	SPX 95 % Setzen Kontingent Januar 2020 Put 865,20, due 1/27/2020	196	0,03
-	USA 10 Jahre November 2019 Put 130,00, due 10/25/2019	19	-
-	10 Jahre Oktober 2019 in den USA Put 129,50, due 9/20/2019	3	-
7.470	USD -Anruf/EUR Put 1,1296, due 10/9/2019	196	0,03
13.330	USD -Anruf/EUR Put 1,1340, due 10/16/2019	393	0,05
10.990	USD -Anruf/EUR Put 110,00, due 10/22/2019	164	0,02
11.730	USD Put/JPY Call 108,0390, due 11/1/2019	298	0,04
7.670	USD Put/RUB Call 65,2772, due 11/21/2019	46	0,01
Gekaufte Optionen insgesamt (Anschaffungskosten USD 1.288)		1.751	0,24
Zinsswaps – (0,19 %) (28. Februar 2019: 0,10 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.373	0,19
Swaptions – 0,00 % (28. Februar 2017: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		39	-
Devisenterminkontrakte – 0,36 % (28. Februar 2017: 2,45 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		2.658	0,36
Futures – 0,22 % (28. Februar 2017: 0,05 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.661	0,22
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		734.677	99,49
Verkaufte Optionen – (0,09 %) (28. Februar 2017: 0,00 %)			
-	S&P 500 E-Mini September 2019 Put 2.550,00, due 9/20/2019	(4)	-
-	S&P 500 E-MINI W3 November 2019 Put 2.700,00, due 11/15/2019	(94)	(0,01)
-	S&P 500 E-Mini W3 Oktober 2019 Put 2.400,00, due 10/18/2019	(15)	-
-	S&P 500 E-Mini W3 Oktober 2019 Put 2.500,00, due 10/18/2019	(17)	-
-	USA 10 Jahre November 2019 Call 133,00, due 10/25/2019	(29)	(0,01)
-	10 Jahre Oktober 2019 in den USA Call 133,50, due 9/20/2019	(8)	-
(7.670)	USD -Anruf/AUD Put 0,66, due 11/21/2019	(57)	(0,01)
(7.570)	USD -Anruf/CAD Put 1,3340, due 10/2/2019	(44)	(0,01)
(7.660)	USD -Anruf/CAD Put 1,3605, due 11/18/2019	(26)	-
(10.950)	USD -Anruf/EUR Put 1,0945, due 10/25/2019	(69)	(0,01)
(7.470)	USD -Anruf/EUR Put 1,1109, due 10/9/2019	(94)	(0,01)
(3.830)	USD -Anruf/MXN Put 20,5260, due 11/23/2019	(68)	(0,01)
(7.670)	USD -Anruf/RUB Put 70,4550, due 11/21/2019	(61)	(0,01)
(5.395)	USD Put/JPY Call 101,31, due 11/26/2019	(25)	-
(10.790)	USD Put/JPY Call 102,70, due 10/25/2019	(45)	(0,01)
Veräußerte Optionen gesamt (Anschaffungskosten USD (650))		(656)	(0,09)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD –	% des Nettoinventarwerts
Credit Default Swaps – (0,16 %) 28. Februar 2019 0,06 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.168)	(0,16)
Zinsswaps – (1,30 %) 28. Februar 2019 0,21 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(9.596)	(1,30)
Devisenterminkontrakte – (0,33 %) 28. Februar 2019 0,08 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(2.408)	(0,33)
Futures – (0,13 %) (28. Februar 2017: 0,22 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(991)	(0,13)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	(14.819)	(2,01)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	719.858	97,48
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	18.539	2,52
Nettovermögen insgesamt	USD 738.397	100,00

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

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2018 beliefen sich diese Wertpapiere auf 66.000 USD und machten 39,55 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2018.

† Illiquide.

∞ Das Wertpapier wurde vom Anlageverwalter nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.

Für das Wertpapier besteht am 28. Februar 2018 Zahlungsausfall.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2018.

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

ABKÜRZUNGEN:

CPI	– Verbraucherpreisindex (Consumer Price Index)
Perpetual	– Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit
ARS	– Argentinische Peso
BRL	– Brasilianische Real
EGP	– Ägyptisches Pfund
EUR	Euro
GBP	– Britisches Pfund
IDR	– Indonesische Rupiah
JPY	– Japanischer Yen
RUB	– Russische Rubel

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	85,02
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	9,40
Investmentfonds	0,96
Derivate	0,98
Sonstige Vermögenswerte	3,64
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5.000 %	Kauf	6/20/24	17.419	USD (1.168)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD–)					USD –
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (407))					(1.168)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (407))					USD (1.168)

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Ende der Laufzeit	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 2,250 %	26.04.22	41.804	USD 447
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,300 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	26.04.23	42.588	(466)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,200 %	17.07.24	227.766	224
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,250 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	31.12.25	18.724	(1.059)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	01.31.26	40.504	(2.946)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450 %	18.07.29	170.990	347
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,440 %	20.07.29	178.050	355
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,875 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.05.44	8.541	(2.422)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,750 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.08.44	9.639	(2.497)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,498 %, Receive Floating EUR 6M Euribor Reuters	23.08.47	213	(96)
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	04.01.27	9.200	(8)
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	04.01.27	9.829	(9)
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	04.01.27	7.800	(7)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 6,870 %	04.01.27	32.130	(82)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,044 %	04.01.27	6.400	(4)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2017 (in Tsd.): 756 USD)				USD 1.373
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD (1.565))				(9.596)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD (809))				USD (8.223)

Aufstellung der Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Wirksamkeitsdatum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Barclays	Swaption Payer Strike 0.65 %	19.9.2019	122.000	USD 36
Credit Suisse	Swaption Payer Strike 0.70 %	19.9.2019	18.140	3
Nicht realisierte Wertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD –)				39
Nicht realisierte Wertminderung von Swaptions (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD –)				-
Nettowertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD–)				USD 39

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	438	Verkauf	GBP	358	USD	2
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	CHF	-		-
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	24	Verkauf	GBP	20		-
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	230	Verkauf	GBP	191		-
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	22.213	Verkauf	USD	24.952		(519)
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	80	Verkauf	USD	96		1
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	560.489	Verkauf	USD	682.605		(293)
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	CHF	67	Verkauf	USD	69		(1)
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	43.181	Verkauf	USD	29.302		(213)
02.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	1.676	Verkauf	CAD	2.192		29
10.10.19	JP Morgan	Kauf	EUR	1.830	Verkauf	USD	2.067		(50)
15.10.19	Citi	Kauf	USD	2.166	Verkauf	ARS	102.662		678
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	10.180	Verkauf	EUR	9.006		247
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	170	Verkauf	GBP	140		-
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	2.730	Verkauf	JPY	287.120		17
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	1.679	Verkauf	JPY	178.945		(12)
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	1	Verkauf	PLN	3		-
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	25	Verkauf	TRY	149		-
17.10.19	Barclays	Kauf	AUD	2.170	Verkauf	USD	1.467		(3)
17.10.19	Barclays	Kauf	CAD	4.496	Verkauf	USD	3.431		(52)
17.10.19	Barclays	Kauf	IDR	89.707.096	Verkauf	USD	6.247		32
17.10.19	Barclays	Kauf	INR	246.638	Verkauf	USD	3.509		(92)
17.10.19	Barclays	Kauf	JPY	114.510	Verkauf	USD	1.085		(4)
17.10.19	Barclays	Kauf	JPY	299.410	Verkauf	USD	2.767		60
17.10.19	Barclays	Kauf	EUR	2.810	Verkauf	USD	3.132		(33)
17.10.19	Barclays	Kauf	GBP	566	Verkauf	USD	711		(21)
17.10.19	Barclays	Kauf	USD	1	Verkauf	ZAR	12		-
17.10.19	BNP Paribas	Kauf	USD	7.297	Verkauf	AUD	10.746		50
17.10.19	BNP Paribas	Kauf	USD	1.601	Verkauf	CAD	2.130		-
17.10.19	BNP Paribas	Kauf	USD	687	Verkauf	EUR	617		7
17.10.19	Citi	Kauf	USD	8.068	Verkauf	AUD	11.617		234
17.10.19	Citi	Kauf	USD	548	Verkauf	CAD	729		-
17.10.19	Citi	Kauf	USD	69	Verkauf	COP	222.474		4
17.10.19	Citi	Kauf	USD	7.779	Verkauf	EUR	6.934		133
17.10.19	Citi	Kauf	USD	3.445	Verkauf	JPY	362.160		24
17.10.19	Citi	Kauf	USD	6.084	Verkauf	RUB	392.992		229
17.10.19	Citi	Kauf	MXN	191.210	Verkauf	USD	9.845		(378)
17.10.19	Citi	Kauf	EUR	8.849	Verkauf	USD	9.890		(130)
17.10.19	Citi	Kauf	AUD	330	Verkauf	USD	224		(1)
17.10.19	Citi	Kauf	GBP	350	Verkauf	USD	425		2
17.10.19	Citi	Kauf	BRL	1.852	Verkauf	USD	487		(42)
17.10.19	Citi	Kauf	JPY	179.171	Verkauf	USD	1.663		29
17.10.19	Goldman Sachs	Kauf	JPY	30.770	Verkauf	USD	284		6
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	29.086	Verkauf	EUR	25.642		804
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	5.516	Verkauf	IDR	79.108.180		(21)
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	514	Verkauf	JPY	54.460		-
17.10.19	JP Morgan	Kauf	JPY	747.010	Verkauf	USD	7.054		1
17.10.19	JP Morgan	Kauf	JPY	115.110	Verkauf	USD	1.090		(3)
17.10.19	JP Morgan	Kauf	AUD	1.690	Verkauf	USD	1.163		(23)
17.10.19	JP Morgan	Kauf	PHP	30.897	Verkauf	USD	600		(9)
17.10.19	JP Morgan	Kauf	TWD	1.100	Verkauf	USD	36		(1)
17.10.19	JP Morgan	Kauf	EUR	11.018	Verkauf	USD	12.449		(297)
23.10.19	Citi	Kauf	EUR	4.945	Verkauf	USD	5.507		(49)
28.10.19	Barclays	Kauf	JPY	213.516	Verkauf	USD	2.029		(10)
28.10.19	Citi	Kauf	USD	2.440	Verkauf	EUR	2.190		22
05.11.19	Barclays	Kauf	USD	5.091	Verkauf	JPY	550.007		(110)
15.11.19	Barclays	Kauf	USD	601	Verkauf	PHP	30.900		11
18.11.19	BNP Paribas	Kauf	USD	1.751	Verkauf	CAD	2.330		(1)
18.11.19	JP Morgan	Kauf	CAD	2.331	Verkauf	USD	1.752		-
21.11.19	Barclays	Kauf	RUB	233.019	Verkauf	USD	3.455		1
21.11.19	Citi	Kauf	USD	3.452	Verkauf	RUB	233.019		(4)
22.11.19	BNP Paribas	Kauf	USD	1.786	Verkauf	AUD	2.630		11
22.11.19	Citi	Kauf	AUD	2.630	Verkauf	USD	1.787		(12)
26.11.19	Citi	Kauf	USD	1.094	Verkauf	MXN	21.942		15
26.11.19	Citi	Kauf	MXN	21.942	Verkauf	USD	1.093		(14)
27.11.19	Citi	Kauf	USD	1.080	Verkauf	JPY	113.036		9
27.11.19	Citi	Kauf	JPY	113.036	Verkauf	USD	1.080		(10)

Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD 17.918)		2.658
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD (605))		(2.408)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD 17.313)	USD	250

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
90 Day Euro USD June 2020	148	USD 36.484	USD	555
Australia 10 Year Bond March 2019	46	4.609		191
Euro-Bund Juni 2019	(62)	(12.012)		-
Euro-Bund Juni 2019	(48)	(9.448)		(434)
Euro-Buxl 30 Jahre Bond September 2019	(2)	(493)		(62)
Fed Fund 30 Tage Januar 2020	(72)	(29.541)		(81)
Fed Fund 30 Day September 2019	(27)	(11.011)		4
Long Gilt June 2019	(15)	(2.451)		(9)
U.S. 10 Year Note (CBT) March 2019	624	82.193		175
10 Jahre Ultra Note Dezember 2019 in den USA	5	722		3
U.S. 2 Year Note (CBT) March 2019	3	648		-
U.S. 5 Year Note (CBT) March 2019	(1.357)	(162.808)		(405)
U.S. Long Bond (CBT) March 2019	(72)	(11.898)		12
U.S. Ultra Bond (CBT) March 2019	327	64.562		721
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD 397			USD	1.661
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD (1.614))				(991)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD (1.217))			USD	670

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettovermögenswert
Asset-Backed Securities - 0,04 % (28. Februar 2019: 0,18 %)			
23	Missouri Higher Education Loan Authority, Serie 2010 3, Klasse A1, 2,982 %, due 8/26/2030 *	23	0,04
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 22)		23	0,04
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 31,79 % (28. Februar 2019: 33,33 %)			
Belgien – 0,41 % (28. Februar 2019: 0,50 %)			
200	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,150 %, due 1/23/2025	219	0,41
Kanada – 0,63 % (28. Februar 2019: 0,56 %)			
250	Barrick North America Finance LLC, 5,750 %, due 5/1/2043	337	0,63
China – 0,97 % (28. Februar 2019: 1,04 %)			
EUR 450	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 1,750 %, due 6/14/2022	513	0,97
Kolumbien – 2,30 % (28. Februar 2019: 2,32 %)			
40	Ecopetrol SA, 5,875 %, due 9/18/2023	45	0,08
120	Ecopetrol SA, 4,125 %, due 1/16/2025	126	0,24
939	Ecopetrol SA, 5,375 %, due 6/26/2026	1.053	1,98
		1.224	2,30
Frankreich – 0,24 % (28. Februar 2019: 0,26 %)			
EUR 110	BNP Paribas SA, 2,875 %, due 3/20/2026 *	126	0,24
Deutschland – 1,30 % (28. Februar 2019: 1,24 %)			
GBP 162	innogy Finance BV, 5,625 %, due 12/6/2023	233	0,44
EUR 100	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, due 5/26/2049 *	133	0,25
EUR 280	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, due 10/1/2024	323	0,61
		689	1,30
Mexiko – 0,40 % (28. Februar 2019: 0,42 %)			
200	Mexichem SAB de CV, 4,875 %, due 9/19/2022	210	0,40
Niederlande – 1,31 % (28. Februar 2019: 1,41 %)			
EUR 130	ABN AMRO Bank NV, 7,125 %, due 7/6/2022	171	0,32
400	Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,125 %, due 4/26/2021	407	0,77
EUR 100	ING Groep NV, 2,500 %, due 2/15/2029 *	120	0,22
		698	1,31
Norwegen – 0,38 % (28. Februar 2019: 0,41 %)			
EUR 180	DNB Bank ASA, 1,125 %, due 3/20/2028 *	204	0,38
Peru – 0,44 % (28. Februar 2019: 0,40 %)			
200	Southern Copper Corp, 5,250 %, due 11/8/2042	232	0,44
Singapur – 0,40 % (28. Februar 2019: 0,41 %)			
200	DBS Group Holdings Ltd, 4,520 %, due 12/11/2028 *	214	0,40
Südafrika – 0,45 % (28. Februar 2019: 0,46 %)			
EUR 200	Anglo American Capital Plc, 1,625 %, due 9/18/2025	237	0,45
Spanien – 0,93 % (28. Februar 2019: 0,98 %)			
EUR 100	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0,750 %, due 9/11/2022	113	0,21
EUR 200	Banco Santander SA, 3,250 %, due 4/4/2026	255	0,48
50	Telefonica Emisiones SA, 5,462 %, due 2/16/2021	52	0,10
GBP 50	Telefonica Emisiones SA, 5,375 %, due 2/2/2026	74	0,14
		494	0,93
Schweden – 0,26 % (28. Februar 2019: 0,54 %)			
EUR 120	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, due 3/2/2028 *	137	0,26
Schweiz – 2,06 % (28. Februar 2019: 1,98 %)			
100	ABB Finance USA Inc, 2,800 %, due 4/3/2020	100	0,19
480	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd, 4,875 %, due 5/15/2045	608	1,15
EUR 220	Glencore Finance Europe Ltd, 1,875 %, due 9/13/2023	257	0,48
EUR 110	UBS AG, 4,750 %, due 2/12/2026 *	129	0,24
		1.094	2,06
Großbritannien – 1,78 % (28. Februar 2019: 1,98 %)			
GBP 160	Aviva Plc, 5,125 %, due 6/4/2050 *	220	0,41
EUR 160	Barclays Plc, 2,625 %, due 11/11/2025 *	178	0,33
GBP 130	BUPA Finance Plc, 5,000 %, due 4/25/2023	174	0,33
GBP 120	Close Brothers Finance Plc, 3,875 %, due 6/27/2021	153	0,29
EUR 166	Lloyds Bank Plc, 6,500 %, due 3/24/2020	189	0,36
30	Santander UK Plc, 2,375 %, due 3/16/2020	30	0,06
		944	1,78
USA – 17,53 % (28. Februar 2019: 18,42 %)			
107	AbbVie Inc, 3,600 %, due 5/14/2025	112	0,21
26	Allergan Funding SCS, 3,800 %, due 3/15/2025	27	0,05
30	Amgen Inc, 2,125 %, due 5/1/2020	30	0,06
200	Anadarko Petroleum Corp, 6,600 %, due 3/15/2046	265	0,50
70	Anthem Inc, 4,350 %, due 8/15/2020	72	0,13
290	Apple Inc, 1,550 %, due 8/4/2021	289	0,54
60	Bank of America Corp, 4,100 %, due 7/24/2023	65	0,12
350	Bank of America Corp, 3,550 %, due 3/5/2024 *	366	0,69
501	Bank of America Corp, 4,000 %, due 1/22/2025	536	1,01
140	Bank of America Corp, 7,750 %, due 5/14/2038	219	0,41
100	BP Capital Markets America Inc, 4,500 %, due 10/1/2020	103	0,19
40	Celgene Corp, 2,250 %, due 8/15/2021	40	0,08
150	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,579 %, due 7/23/2020	151	0,28
330	Citigroup Inc, 4,450 %, due 9/29/2027	363	0,68
133	Citigroup Inc, 8,125 %, due 7/15/2039	223	0,42
34	Citigroup Inc, 5,300 %, due 5/6/2044	43	0,08
468	CVS Health Corp, 3,350 %, due 3/9/2021	477	0,90
270	Devon Energy Corp, 5,850 %, due 12/15/2025	324	0,61
40	Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, due 2/15/2045	48	0,09
80	FirstEnergy Corp, Serie C, 7,375 %, due 11/15/2031	115	0,22
EUR 140	GE Capital European Funding Unlimited Co, 0,800 %, due 1/21/2022	154	0,29
10	General Electric Co, 5,500 %, due 1/8/2020	10	0,02
70	General Electric Co, 4,625 %, due 1/7/2021	72	0,13
30	General Electric Co, 5,300 %, due 2/11/2021	31	0,06
280	General Motors Financial Co Inc, 3,550 %, due 4/9/2021	285	0,54
10	Gilead Sciences Inc, 2,550 %, due 9/1/2020	10	0,02
40	Gilead Sciences Inc, 4,800 %, due 4/1/2044	48	0,09
20	Gilead Sciences Inc, 4,750 %, due 3/1/2046	24	0,05
150	Goldman Sachs Group Inc/ The, 6,250 %, due 2/1/2041	213	0,40
453	Goldman Sachs Group Inc/ The, 5,150 %, due 5/22/2045	550	1,04
260	HCA Inc, 5,000 %, due 3/15/2024	284	0,53
170	HCA Inc, 5,250 %, due 6/15/2026	192	0,36
500	HSBC Bank USA NA, 4,875 %, due 8/24/2020	513	0,97
90	JPMorgan Chase & Co, 4,500 %, due 1/24/2022	95	0,18
171	JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, due 6/1/2045	220	0,41
20	Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500 %, due 3/1/2021	20	0,04
GBP 220	Kraft Heinz Foods Co, 4,125 %, due 7/1/2027	295	0,56
170	McDonald's Corp, 3,350 %, due 4/1/2023	178	0,34
EUR 150	Medtronic Global Holdings SCA, 1,125 %, due 3/7/2027	177	0,33
90	MetLife Inc, 6,400 %, due 12/15/2036	105	0,20
570	Microsoft Corp, 2,400 %, due 2/6/2022	580	1,09
50	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, due 8/15/2029	51	0,10
160	Time Warner Cable LLC, 5,500 %, due 9/1/2041	175	0,33
110	Time Warner Entertainment Co LP, 8,375 %, due 7/15/2033	154	0,29
40	UnitedHealth Group Inc, 2,700 %, due 7/15/2020	40	0,08
30	UnitedHealth Group Inc, 2,875 %, due 12/15/2021	31	0,06
84	Verizon Communications Inc, 4,329 %, due 9/21/2028	97	0,18
40	Verizon Communications Inc, 5,500 %, due 3/16/2047	54	0,10
30	Verizon Communications Inc, 4,522 %, due 9/15/2048	36	0,07
150	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual *	150	0,28
4	Wells Fargo & Co, 4,100 %, due 6/3/2026	4	0,01
100	Wells Fargo & Co, 4,300 %, due 7/22/2027	111	0,21
120	Wells Fargo & Co, 4,650 %, due 11/4/2044	144	0,27
330	Williams Cos Inc/The, 5,250 %, due 3/15/2020	335	0,63
		9.306	17,53
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 15.896)		16.878	31,79
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 60,28 % (28. Februar 2019: 59,68 %)			
Belgien – 0,89 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
EUR 320	Königreich Belgien Government Bond, Serie 88, 144A, 1,700 %, due 6/22/2050	471	0,89

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)			wert (in Tsd.) USD	% des Nettovermögenswert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)				
Frankreich – 2,62 % (28. Februar 2019: 2,78 %)				
EUR	890	FRENCH REPUBLIC Government Bond OAT, Serie OATe, 1,850 %, due 7/25/2027 β	1.393	2,62
Indonesien – 3,71 % (28. Februar 2019: 3,86 %)				
IDR	26.567.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR79, 8,375 %, due 4/15/2039	1.969	3,71
Italien – 2,94 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
EUR	440	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 2,550 %, due 9/15/2041 β	731	1,38
EUR	590	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250 %, due 9/1/2046	830	1,56
			1.561	2,94
Japan – 1,78 % (28. Februar 2019: 1,82 %)				
JPY	95.600	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100 %, due 3/10/2026 β	945	1,78
Kuwait – 1,04 % (28. Februar 2019: 1,02 %)				
	500	Kuwait International Government Bond, 3,500 %, due 3/20/2027	550	1,04
Mexiko – 4,14 % (28. Februar 2019: 3,83 %)				
MXN	35.196	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, due 11/13/2042	1.812	3,41
EUR	210	Mexico Government International Bond, 2,875 %, due 4/8/2039	263	0,50
	100	Mexico Government International Bond, 5,550 %, due 1/21/2045	123	0,23
			2.198	4,14
Polen – 6,10 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
PLN	11.980	Republik Polen Government Bond, Serie 0428, 2,750 %, due 4/25/2028	3.238	6,10
Saudi-Arabien – 0,58 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
EUR	250	Saudi Government International Bond, 2,000 %, due 7/9/2039	310	0,58
Südafrika – 2,31 % (28. Februar 2019: 2,57 %)				
ZAR	19.740	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500 %, due 2/28/2041	915	1,73
	310	Republic of South Africa Government International Bond, 4,300 %, due 10/12/2028	309	0,58
			1.224	2,31
Südkorea – 0,08 % (28. Februar 2019: 0,09 %)				
KRW	50.130	Korea Treasury Bond, Serie 2606, 1,875 %, due 6/10/2026	43	0,08
Spanien – 4,36 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
EUR	1.470	Spain Government Bond, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, due 10/31/2048	2.315	4,36
Türkei – 0,51 % (28. Februar 2019: 1,21 %)				
TRY	2.070	Turkey Government Bond, 10,500 %, due 8/11/2027	273	0,51
Vereinigte Arabische Emirate - 1,43 % (28. Februar 2019: 1,22 %)				
	610	Abu Dhabi Government International Bond, 4,125 %, due 10/11/2047	760	1,43
Großbritannien – 0,36 % (28. Februar 2019: 0,37 %)				
GBP	90	United Kingdom Gilt, 4,500 %, due 12/7/2042	190	0,36
USA – 27,43 % (28. Februar 2019: 40,91 %)				
	1.600	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, due 4/15/2024 β	1.659	3,12
	20	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 9/30/2019	20	0,04
	30	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, due 2/15/2020	30	0,06
	4.410	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 3/31/2022	4.444	8,37
	10	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 11/15/2024	10	0,02
	40	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 12/31/2024	42	0,08
	6.180	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, due 2/15/2025	6.367	11,99
	770	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 11/15/2025	807	1,52
	400	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, due 8/31/2026	398	0,75
	30	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	37	0,07
	620	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	747	1,41
			14.561	27,43
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 31.351)			32.001	60,28
Investmentfonds - 4,50 % (28. Februar 2019: 2,70 %)				
	9	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Legg Mason Western Asset India Bond Fund – LM Klasse USD, thesaurierend	1.107	2,09
	1.281	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	1.281	2,41
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 2.352)			2.388	4,50
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 49.621)			51.290	96,61

Kontrakte (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettovermögenswert
Gekaufte Optionen – 0,02 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
EUR	– Euro-BPT Future November 2019 Put 136,50, due 10/25/2019	8	0,02
EUR	– Euro-Bund December 2019 Call 201,00, due 11/22/2019	2	–
	– IMM Euro$ December 2019 Call 99,00, due 12/16/2019	2	–
	– U.S. 10 Year November 2019 Put 115,00, due 11/22/2019	–	–
	– U.S. 5 Year December 2019 Call 130,75, due 11/22/2019	–	–
Gekaufte Optionen insgesamt (Anschaffungskosten USD 16)		12	0,02
Devisenterminkontrakte – 0,62 % (28. Februar 2019: 0,41 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		330	0,62
Futures – 0,44 % (28. Februar 2019: 0,92 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		235	0,44
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		51.867	97,69
Verkaufte Optionen – (0,41 %) (28. Februar 2019: (0,11 %))			
EUR	– Euro-BPT Future November 2019 Call 145,00, due 10/25/2019	(15)	(0,03)
EUR	– Euro-Bund October 2019 Put 174,00, due 9/20/2019	(3)	(0,01)
	– IMM Euro$ December 2019 Call 97,25, due 12/16/2019	(98)	(0,18)
	– U.S. 10 Year October 2019 Call 130,00, due 9/20/2019	(60)	(0,11)
	– U.S. 10 Year October 2019 Call 131,50, due 9/20/2019	(17)	(0,03)
	– U.S. Bond November 2019 Call 166,00, due 10/25/2019	(25)	(0,05)
Veräußerte Optionen gesamt (Anschaffungskosten USD (106))		(218)	(0,41)
Devisenterminkontrakte – (0,26 %) (28. Februar 2019: (1,73 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(141)	(0,26)
Futures – (0,93 %) (28. Februar 2019: (0,20 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(493)	(0,93)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(852)	(1,60)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten		51.015	96,09
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		2.073	3,91
Nettovermögen insgesamt		USD 53.088	100,00

–	Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
144A	Von der Registrierung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 31. August 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 4.347.000 oder 8,19 % des Nettovermögens.
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.
β	Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

CPI	– Verbraucherpreisindex (Consumer Price Index)
Perpetual	– Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund
IDR	– Indonesische Rupiah
JPY	– Japanischer Yen
KRW	– Südkoreanische Won
MXN	– Mexikanischer Peso
PLN	– Polnischer Zloty
TRY	– Türkische Lira
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	89,81
Investmentfonds	4,39
Derivate	1,06
Sonstige Vermögenswerte	4,74
Gesamtvermögen	100,00

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	GBP	1	USD –
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	2	Verkauf	USD	2	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	JPY	5.179.373	Verkauf	USD	48.839	(50)
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	339	Verkauf	USD	381	(7)
21.10.19	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	RUB	58.380	Verkauf	USD	870	(1)
21.10.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	534	Verkauf	KRW	644.981	1
21.11.19	Citi	Kauf	USD	4.032	Verkauf	EUR	3.592	60
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.638	Verkauf	AUD	2.415	8
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	74	Verkauf	CAD	98	–
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	4.072	Verkauf	EUR	3.615	74
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	55	Verkauf	GBP	46	–
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	619	Verkauf	MXN	12.372	11
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	302	Verkauf	PLN	1.164	9
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	597	Verkauf	TRY	3.471	20
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	JPY	369.750	Verkauf	USD	3.541	(41)
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	SEK	6.780	Verkauf	USD	715	(20)
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	NOK	1.561	Verkauf	USD	175	(4)
21.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	86	Verkauf	ZAR	1.340	(1)
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	7.240	Verkauf	EUR	6.434	125
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	30	Verkauf	GBP	25	–
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	725	Verkauf	GBP	598	(6)
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	4.473	Verkauf	JPY	471.006	15
21.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	175	Verkauf	NOK	1.560	3
21.11.19	JP Morgan	Kauf	GBP	320	Verkauf	USD	388	3
21.11.19	JP Morgan	Kauf	PLN	1.150	Verkauf	USD	295	(6)
21.11.19	JP Morgan	Kauf	CAD	1.481	Verkauf	USD	1.115	(1)
21.11.19	JP Morgan	Kauf	AUD	1.204	Verkauf	USD	814	(1)
21.11.19	Morgan Stanley	Kauf	AUD	1.220	Verkauf	USD	826	(3)
21.11.19	UBS	Kauf	USD	73	Verkauf	EUR	64	1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 204)								330
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (859))								(141)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (655))								USD 189

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro$ December 2019	(10)	USD (2.454)	USD (22)
Euro-Bobl September 2019	(17)	(2.545)	(48)
Euro-BTP September 2019	16	2.555	145
Euro-Bund December 2019	(207)	(40.104)	(200)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2019	(1)	(247)	(31)
Euro-OAT September 2019	(8)	(1.498)	(72)
Euro-Schatz September 2019	(42)	(5.197)	(26)
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2019	(1)	(1.461)	(16)
Long Gilt December 2019	(26)	(4.248)	(16)
U.S. 10 Year Note (CBT) December 2019	79	10.406	42
U.S. 10 Year Ultra Note December 2019	(4)	(578)	(2)
U.S. 2 Year Note (CBT) December 2019	(8)	(1.729)	–
U.S. 5 Year Note (CBT) December 2019	(142)	(17.037)	(60)
U.S. Long Bond (CBT) December 2019	37	6.114	48
U.S. Ultra Bond (CBT) December 2019	(1)	(197)	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 458)			USD 235
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (100))			(493)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 358)			USD (258)

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventar-werts
Asset-Backed Securities - 16,68 % 28. Februar 2019 16,35 %)			
1.190	Nelnet Student Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Klasse M5 * 5,180 %, due 4/25/2035 *	1.222	0,08
739	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust RAMP Series 2005-RM1 Trust, Series 2005 RM1, Klasse M4 * 3,165 %, due 3/25/2035 *	725	0,05
5.325	Aegis Asset Backed Securities Trust 2005-1, Serie 2005 1, Klasse M5, 2,895 %, due 3/25/2035 *	4.430	0,29
4.560	Aegis Asset Backed Securities Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse M3, 2,635 %, due 8/25/2035 *	3.917	0,25
39	AFC Trust Series 2000-3, Series 2000 V1A, Klasse A1, 1A, 144A 2,895 %, due 10/25/2030 *	36	-
4.838	Ameriquest Hypothek Wertpapiere, Die Zugewiesen Wurden Pass-Through Ctfs Ser 200 4 FR 1, Serie 2004 FR1, Klasse M4, 4,387 %, fällig am 25./2034	4.904	0,32
2.235	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Serie 2019 1A, Klasse A2I, 144A, 4,194 %, fällig 6/7/2049	2.299	0,15
12.000	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Serie 2019 1A, Klasse A2II, 144A, 4,723 %, fällig am 07.06.2049	12.528	0,81
4.210	Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Serie OOMC 2006-HE5, 2006 HE5, Klasse M1, 2,425 %, due 7/25/2036 *	3.615	0,23
8.011	Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Serie RFC 2007-HE1, 2007 HE1, Klasse A4, 2,285 %, due 12/25/2036 *	7.790	0,50
2.390	BankAmerica Hergestelltes Housing Contract Trust, 2005-4, Series 1996 1, Klasse B1, 7,875 %, due 10/10/2026	582	0,04
1.147	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Serie 2007 B, Klasse 1A2, 6,831 %, fällig am 28. August 2047	1.131	0,07
1.244	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Serie 2007 B, Klasse 1A3, 7,219 %, fällig am 28. 8/2047	529	0,03
833	BCMSC Trust 1998-C, 1998 AR17, Klasse M1, 7,510 %, due 1/15/2029 *	737	0,05
201	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Serie 2005 CL1, Klasse A1, 2,116 %, fällig am 25. September 2034 *	196	0,01
895	Bear Stearns Asset Backed Securities Trust 2006 - 1, 2005-4, Series 2006 1, Klasse M1, 2,645 %, due 2/25/2036 *	897	0,06
4.124	Hypothekenkredit Der Citigroup Trust Inc, Serie 2006 WFH2, Klasse M3, 2,455 %, due 8/25/2036 *	3.228	0,21
2.025	Hypothekenkredit Der Citigroup Trust Series 2004-OPT1 Asset-Backed Pass-Through-Zertifizierung, Serie 2004 OPT1, Klasse M5, 3,720 %, fällig am 25.10.2034 *	2.045	0,13
1.589	Conseco Finance Corp, 2005-4, Series 1997 4, Klasse M1, 7,220 %, due 2/15/2029 *	1.655	0,11
5.868	Conseco Finance Verbriefungen Corp, Serie 2000 3, Klasse A, 144A, 8,260 %, fällig am 1.12.2030 *	3.262	0,21
155	Länderweit Asset-Based Certificates, Serie 2003 BC5, Klasse 2A2, 2,845 %, due 12/25/2033 *	154	0,01
1.292	Länderweit Asset-Based Certificates, Serie 2007 SD1, Klasse A1, 144A, 2,595 %, due 3/25/2047 *	1.002	0,07
2.500	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC, Serie 2007 MX1, Klasse A4, 144A, 6,231 %, due 12/25/2036	2.695	0,17
4.373	CSMC 2019-RPL1 Trust, Series 2019 RPL1, Klasse B1, 144A, 3,084 %, due 7/25/2057 *	3.679	0,24
5.017	CSMC 2019-RPL1 Trust, Series 2019 RPL1, Klasse B2, 144A, 3,084 %, due 7/25/2057 *	3.740	0,24
4.266	CSMC 2019-RPL1 Trust, Series 2019 RPL1, Klasse B3, 144A, 3,084 %, due 7/25/2057 *	2.750	0,18
4.883	CSMC 2019-RPL1 Trust, Series 2019 RPL1, Klasse B4, 144A, 3,084 %, due 7/25/2057 *	740	0,05
1.888	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-9, 2005-4, Series 2004 9, Klasse MF2, 5,572 %, due 11/25/2034 *	2.003	0,13
1.709	CWABS Drehheim Equity Loan Trust Serie 2004-B, Serie 2004 B, Klasse 2A, 2,415 %, due 2/15/2029 *	1.581	0,10
1.386	CWABS Drehheim Equity Loan Trust Serie 2004-J, Serie 2004 J, Klasse 1A, 2,485 %, due 12/15/2033 *	1.384	0,09
58	CWABS Drehheim Equity Loan Trust Serie 2004-J, Serie 2004 J, Klasse 2A, 2,485 %, due 12/15/2033 *	57	-
3.089	Dividende Solar Loans 2019-1 LLC, Serie 2019 1, Klasse C, 144A, 7,000 %, due 3/22/2038	3.258	0,21
2.402	Dividende Solar Loans 2018-1 LLC, Serie 2018 1, Klasse D, 144A, 6,390 %, due 7/20/2038	2.556	0,17
3.602	Dividende Solar Loans 2018-2 LLC, Serie 2018 2, Klasse C, 144A, 4,930 %, due 12/20/2038 †	3.869	0,25
4.894	Dividende Solar Loans 2018-2 LLC, Serie 2018 2, Klasse D, 144A, 5,910 %, due 12/20/2038	5.226	0,34
12.000	EFS Volunteer No 2 LLC, Series 2012 USA, Klasse A2, 144A, 144A 3,495 %, due 3/25/2036 *	12.101	0,78
3.670	FFMLT Trust 2005-FF8, 2005 FF8, Klasse M2, 2,925 %, due 9/25/2035 *	3.685	0,24
4.869	Fieldstone Mortgage Investment Trust Lehman Mortgage Trust 2005-2, Series 2005 2, Klasse M3 2,925 %, due 12/25/2035 *	3.242	0,21
8	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2002-FF1, Series 2002 FF1, Klasse 1A2 * 3,355 %, due 4/25/2032 *	8	-
7.774	Fremont Home Loan Trust 2006-B, Serie 2006 B, Klasse 1A, 2,295 %, due 8/25/2036 *	3.840	0,25
9.066	HERO Funding Trust 2016-1, Series 2016 1A, Klasse R, 144A, 0,000 %, due 144A 0,000 %, due 9/20/2041	1.740	0,11
2.650	Home Equity Hypothekenkredit Asset-Backed Trust Serie INABS 2005-B, 2005 AR17, Klasse M6, 3,210 %, due 8/25/2035	2.551	0,17
1.850	INSITE Emittent LLC, Serie 2016 1A, Klasse C, 144A, 6,414 %, due 11/15/2046	1.943	0,13
7.000	HarborView Mortgage Loan Trust, Series 2005 9, Klasse M6, 2.855 % due 12/25/2035 *	5.622	0,36
5.706	HarborView Mortgage Loan Trust, Series 2007 9, Klasse MV4, 2.675 % due 1/25/2037 *	5.321	0,34
2.189	KeyCorp Student Loan Trust 2004-A, Serie 2004 A, Klasse 1B, 2,686 %, due 1/27/2043 *	2.025	0,13
7.910	KeyCorp Student Loan Trust 2005-A, Serie 2005 A, Klasse 2C, 3,611 %, due 12/27/2038 *	7.634	0,49
55	Lehman Mortgage Trust 2002-2, Series 2002 2, Klasse M2 4,066 %, due 7/25/2032 *	55	-
188	SLM Student Loan Trust, Series 2006 2, Klasse A2, 2.405 % due 2/25/2036 *	187	0,01
6	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust Series 2003-SD1, Serie 2003 SD1, Klasse A1, 3,145 %, fällig am 25./2033 *	6	-
7.100	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust, Series 2006 HE1, Klasse M1 * 2,515 %, due 1/25/2036 *	5.756	0,37
6.243	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Klasse 2A1 * 5,866 %, due 1/25/2037	6.287	0,41
2.550	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Klasse 3A4 * 5,860 %, due 1/25/2037	2.574	0,17
1.368	Lehman Mortgage Trust 2005-3, Series 2005 3, Klasse M1 2,820 %, due 6/25/2036 *	1.306	0,08
8.220	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Klasse M5, 3,645 %, due 1/25/2035 *	5.472	0,35
2.323	PFCA Home Equity Investment Trust, Serie 2003 IFC6, Klasse A, 144A, 4,283 %, due 4/22/2035 *	2.374	0,15
1.201	Beliebte ABS-Hypothek CHL Mortgage Pass- Through Trust 2004-4, Series 2004 4, Klasse M2, 4,285 %, due 9/25/2034	1.305	0,08
2.744	Beliebte ABS-Hypothek CHL Mortgage Pass- Through Trust 2005-2, Series 2005 2, Klasse M2, 5,717 %, due 4/25/2035	2.004	0,13
2.590	Beliebte ABS-Hypothek CHL Mortgage Pass- Through Trust 2005-5, Series 2005 5, Klasse MV2, 2,775 %, due 11/25/2035	2.136	0,14
5.046	RAMP Series 2004-RS4 Trust, Series 2004 RS4, Klasse MII2, 4,170 %, due 4/25/2034 *	4.404	0,29
5.200	RAMP Series 2005-RS6 Trust, Series 2005 RS6, Klasse M6, 3,270 %, due 6/25/2035 *	4.806	0,31
993	RAMP Series 2004-KS1 Trust, Series 2004 KS1, Klasse MI2, 5,072 %, due 2/25/2034 *	1.051	0,07
2.065	RAMP Series 2004-KS9 Trust, Series 2004 KS9, Klasse AI5, 5,830 %, due 10/25/2034	2.081	0,13
4.135	RAMP Series 2005-KS12 Trust, Series 2005 KS12, Klasse M4, 2,785 %, due 1/25/2036 *	3.880	0,25
3.900	RAMP Series 2006-KS2 Trust, Series 2006 KS2, Klasse M3, 2,555 %, due 3/25/2036 *	3.580	0,23
732	Ratchet Trading Ltd, 2005-4, Series 2018 1, Klasse M3, 15,190 %, due 1/26/2027 *	712	0,05

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inven-tar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
4.224	Renaissance Home Equity Loan Trust 2004-4, 2005-4, Series 2004 4, Klasse MF2, 5,318 %, due 2/25/2035	3.918	0,25
3.000	Saxon Asset Securities Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse M4, 2,123 %, due 11/25/2035 *	2.590	0,17
5.435	Saxon Asset Securities Trust 2006 - 2, Serie 2006 2, Klasse M2, 2,445 %, due 9/25/2036 *	4.850	0,31
5.332	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006-OP1, Serie 2006 OP1, Klasse M6, 2,815 %, due 10/25/2035 *	4.693	0,30
9.496	SLM Student Loan Trust 2004-10, Serie 2004 10, Klasse B 2,646 %, due 1/25/2040 *	8.714	0,56
3	Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 19981, Klasse A7, 6.510 % due 12/25/2027 *	3	-
3.217	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Serie 2005 9XS, Klasse M2, 2,795 %, due 6/25/2035 *	2.634	0,17
3.197	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-WF4, Serie 2005 WF4, Klasse M8, 4,770 %, due 11/25/2035 *	3.365	0,22
1.871	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2007-BC1, Serie 2007 BC1, Klasse M1, 2,375 %, due 2/25/2037 *	1.448	0,09
2.355	Structured Asset Securities Corp Trust 2005-SC1, Series 2005 SC1, Klasse 1A1, 144A, 2,415 %, due 5/25/2031 *	1.758	0,11
9.651	SUNNOVA HELIOS II EMITTENT LLC 2018-1, SERIE 2018 1A, KLASSE B, 144A, 7,710 %, due 7/20/2048	10.179	0,66
10.000	TES 2019-1 LLC, Series 2019 1A, Klasse B, 144A, 7,740 %, due 10/20/2047 7,740 %, due 10/20/2047	10.032	0,65
3.938	Tes 2019-2 LLC, Serie 2019 2A, Klasse A, 144A, 4,120 %, due 2/20/2048	4.067	0,26
866	Upgrade Pass-Thru Trust I, Serie 2019 1, Klasse CERT, 144A, 14,960 %, due 12/27/2027 *	846	0,06
1.016	Upgrade Pass-Thru Trust I, Serie 2018 2, Klasse A, 144A, 16,537 %, fällig am 15.5.2024	999	0,07
1.212	Upgrade Pass-Thru Trust I, Serie 2018 3, Klasse A, 144A, 15,498 %, fällig am 15.06.2024	1.180	0,08
1.358	Upgrade Pass-Thru Trust I, Serie 2018 5, Klasse A, 144A, 12,075 %, fällig am 15. September 2024	1.335	0,09
1.228	Upgrade Pass-Thru Trust I, Serie 2018 6, Klasse A, 144A, 5,339 %, fällig am 15.10.2024	1.197	0,08
1.404	Upgrade Pass-Thru Trust IV, Serie 2018 4, Klasse A, 144A, 15,308 %, fällig am 15.08.2024	1.364	0,09
744	Upgrade Pass-Thru Trust VII, Serie 2018 7, Klasse A, 144A, 14,784 %, fällig am 15.01.2025	711	0,05
1.911	Vantage Data Center Emittent LLC, Serie 2018 1A, Klasse A2, 144A, 4,072 %, due 2/16/2043	1.989	0,13
Asset-Backed Securities insgesamt (Anschaffungskosten USD 248.425)		257.982	16,68

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inven-tar-werts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 72,23 % (28. Februar 2019: 79,46 %)			
3.000	280 Park Avenue 2019-280P Mortgage Trust, Serie 2019 280P, Klasse C, 144A, 3,445 %, due 9/15/2034 *	3.004	0,19
5.000	280 Park Avenue 2019-280P Mortgage Trust, Serie 2019 280P, Klasse D, 144A, 3,732 %, due 9/15/2034 *	5.009	0,32
802	Alternative Loan Trust 2005-56, Serie 2005 56, Klasse 4A1, 2,455 %, due 11/25/2035 *	798	0,05
813	Alternative Loan Trust 2005-59, Serie 2005 59, Klasse 1A1, 2,502 %, due 11/20/2035 *	801	0,05
4.668	Alternative Loan Trust 2005-61, Serie 2005 61, Klasse 1A2, 2,885 %, due 12/25/2035 *	4.475	0,29
2.447	Alternative Loan Trust 2005- 80CB, Serie 2005 80CB, Klasse 2A1, 6,000 %, due 2/25/2036	2.473	0,16
3.452	Alternative Loan Trust 2006- 19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A14, 6,000 %, due 8/25/2036	3.082	0,20
878	Alternative Loan Trust 2006- 19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A15, 6,000 %, due 8/25/2036	784	0,05
899	Alternative Loan Trust 2006- 19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A16, 6,000 %, due 8/25/2036	802	0,05
1.018	Alternative Loan Trust 2006- 19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A20, 24,329 %, due 8/25/2036 *	1.881	0,12
984	Alternative Loan Trust 2006- 19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A24, 6,000 %, due 8/25/2036	878	0,06
1.252	Alternative Loan Trust 2006- 19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A3, 6,000 %, due 8/25/2036 *	1.118	0,07
133	Alternative Loan Trust 2006- 19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A7, 6,000 %, due 8/25/2036	119	0,01
597	Alternative Loan Trust 2006- 19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A8, 6,000 %, due 8/25/2036	533	0,03
6.657	Alternative Loan Trust 2006 - 28CB, Serie 2006 28CB, Klasse A12, 3,755 %, due 10/25/2036 *†	2.062	0,13
8.498	Alternative Loan Trust 2007- 12T1, Serie 2007 12T1, Klasse A3, 6,000 %, due 6/25/2037	6.371	0,41
10.971	Alternative Loan Trust 2007-22, Serie 2007 22, Klasse 2A16, 6,500 %, due 9/25/2037	7.431	0,48
1.378	Alternative Loan Trust 2007- 23CB, Serie 2007 23CB, Klasse A8, 19,819 %, due 9/25/2037 *	2.225	0,14
9.933	Alternative Loan Trust 2007-5CB, Serie 2007 5CB, Klasse 1A20, 3,315 %, due 4/25/2037 *†	1.723	0,11
4.000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF, Serie 2018 UBS 2. Cla ss E. 144A. 5,295 %, due 4/15/2035 *	4.035	0,26
8.000	Ashford Hospitality Trust 2018-KEYS, Serie 2018 KEYS, Klasse C, 144A, 3,795 %, due 5/15/2035 *	8.014	0,52

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inven-tar-werts
5.705	BAML Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Klasse AJA, 144A, 6,006 %, due 8/10/2045 *	4.239	0,27
14.041	Banc of America Finanziert 2015-R2 Trust, Serie 2015 Klasse 3A3, 144A, 5,302 %, due 4/29/2037 *	11.238	0,73
7.131	Banc of America Finanziert 2015-R2 Trust, Serie 2015 Klasse 8A2, 144A, 3,667 %, due 4/29/2037 *	5.569	0,36
4.020	Banc of America Finanziert 2015-R4 Trust, Serie 2015 Klasse 4A2, 144A, 4,500 %, due 1/27/2030 *	4.235	0,27
2.960	Banc of America Finanziert 2015-R4 Trust, Serie 2015 R4, Klasse F, 144A, 10,144 %, due 1/27/2030	1.451	0,09
1.310	BBCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 USA, Klasse E, 144A, 144A 4,715 %, due 8/10/2033 *	1.239	0,08
9.000	BBCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 USA, Klasse F, 144A, 144A 4,715 %, due 8/10/2033 *	8.209	0,53
6.650	BBCMS Trust 2018-BXH, Series 2018 USA, Klasse A2, 144A, 3,695 %, due 10/15/2037 *	6.650	0,43
6.200	BBCMS Trust 2018-RRI, Serie 2018 RRI, Klasse D, 144A 4,245 %, due 2/15/2033 *	6.206	0,40
1.465	BCAP LLC 2011-RR2 Trust, Series 2011 RR2, Klasse 1A4, 144A, 3,893 %, due 4,599 %, due 7/26/2036 *	1.081	0,07
12.075	BCAP LLC 2011-RR4-I Trust, Series 2011 RR4, Klasse 1A6, 144A, 3,893 %, due 4,404 %, due 3/26/2036 *	9.172	0,59
6.726	BCAP LLC 2014-RR2, Series 2014 RR2, Klasse 10A2, 144A, 2,476 %, due 7/26/2046 *	5.196	0,34
6.611	BCAP LLC 2014-RR2, Series 2014 RR2, Klasse 11A2, 144A, 2,643 %, due 5/26/2037 *	5.322	0,34
2.096	Chase Issuance Trust, Series 2007 A2, Klasse A2, 2.415 % due 4/25/2037 *	1.962	0,13
2.260	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-AC6, Serie 2004 AC6, Klasse A1, 5,750 %, fällig am 25.11.2034	2.300	0,15
9.300	Bellemeade Re 2019-1 Ltd, Serie 2019 1, Klasse M2, 144A 5,495 %, due 10/25/2027 *	9.571	0,62
12.470	Bellemeade Re 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Klasse M2, 144A, 5,045 %, due 4/25/2028 *	12.528	0,81
6.676	Bellemeade Re 2018-3 Ltd, Serie 2018 3A, Klasse B1, 144A, 6,045 %, due 10/25/2027 *	6.725	0,43
13.310	Bellemeade Re 2018-3 Ltd, Serie 2018 3A, Klasse M2, 144A, 4,895 %, due 10/25/2028 *	13.397	0,87
3.000	BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Klasse C, 144A, 4,095 %, due 7/15/2035 *	3.008	0,19
24.000	BHMS 2018-MZB, Serie 2018 MZB, Klasse MZB, 144A, 8,832 %, fällig 7/15/2020 *	24.252	1,57
1.100	BX Commercial Mortgage Series 2018 USA, Klasse E, 144A, 4,146 %, due 3/15/2037 *	1.103	0,07

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventarwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
7.715	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND, Serie 2018 IND, KLASSE D, 144A, 3,495 %, due 11/15/2035 *	7.723	0,50
5.279	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND, Serie 2018 IND, KLASSE G, 144A, 4,245 %, due 11/15/2035 *	5.301	0,34
3.613	BX Trust 2019-SLCT, Series 2019 USA, Klasse F, 144A 6,445 %, due 7/15/2034 *	3.623	0,23
4.500	BX TRUST 2018-GW MZ, Serie 2018 GWMZ, Klasse DRR, 144A, 7,683 %, due 5/15/2037 *	4.507	0,29
10.000	BX Trust 2018-MCSF, Series 2018 USA, Klasse A2, 144A, 3,648 %, due 4/15/2035 *	9.941	0,64
1.423	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2004-4, Serie 2004 Klasse B1, 144A, 2,619 %, due 10/25/2035 *	953	0,06
848	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2005-1, Serie 2005 Klasse A2, 144A, 2,345 %, due 1/25/2036 *	851	0,06
898	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2005-B, Serie 2005 Klasse B1, 144A, 2,545 %, due 6/25/2036 *	745	0,05
762	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-25, Serie 2004 Klasse 2A1, 2,825 %, due 2/25/2035 *	739	0,05
777	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, Serie 2005 Klasse 3A3, 2,815 %, due 4/25/2035 *	653	0,04
839	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, Serie 2005 Klasse 6A1, 2,745 %, due 3/25/2035 *	753	0,05
517	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-25, Serie 2005 Klasse A15, 18,330 %, due 11/25/2035 *	763	0,05
10.250	CHT 2019-COSMO Mortgage Trust, Serie 2019 CSMO, Klasse 144A, 3,595 %, due 11/15/2036 *	10.262	0,66
2.258	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2007-3, 2005-4, Series 2007 3, Klasse 1A4, 6,000 %, due 4/25/2037	2.300	0,15
9.200	Hypothekenkredit Der Citigroup Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Klasse 2A4, 2,365 %, due 9/25/2036 *	3.441	0,22
877	Hypothekenkredit Der Citigroup Vertrauen 2008-3, Serie 2008 3, Klasse A3, 144A, 6,100 %, due 4/25/2037	481	0,03
3.529	Hypothekenkredit Der Citigroup RAAC Trust, Series 2014 J2, Klasse B5, 144A * 3,896 %, due 11/25/2044 *	3.430	0,22
1.908	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Serie 2014 UBS2, Klasse ER, 144A, 5,169 %, due 3/10/2047 *	1.629	0,11
13.450	Connecticut Avenue Securities Trust 2018-R07, Serie 2018 R07, Klasse 1B1, 144A, 6,495 %, due 4/25/2031 *	14.408	0,93
9.999	Connecticut Avenue Securities Trust 2018-R07, Serie 2018 R07, Klasse 1M2, 144A, 4,545 %, due 4/25/2031 *	10.100	0,65
6.500	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Serie 2019 R05, Klasse 1B1, 144A, 6,245 %, due 7/25/2039 *	6.688	0,43
524	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Serie 2006-C5, Serie 2006 BNK 8. Cla ss XA. 5,373 %, due 12/15/2039	356	0,02
4.344	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Serie 2007-C5, Serie 2007 LDP 9. Cla ss AM. 5,869 %, due 9/15/2040 *	3.304	0,21
266	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, 2005 C2, Klasse A1C4, 4,877 %, due 4/15/2037	260	0,02
513	CSFB Mortgage-Backed Passthrough-Zertifikate RAMP Series 2004-AR5 Trust, Series 2004 AR5, Klasse CB2 * 4,533 %, due 6/25/2034 *	495	0,03
6.000	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Klasse A2, 144A, 144A 4,336 %, due 9/15/2037	6.328	0,41
7.000	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Klasse E, 144A, 144A 4,373 %, due 9/15/2037	6.732	0,44
2.500	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Klasse F, 144A, 144A 4,373 %, due 9/15/2037	2.307	0,15
2.690	CSMC 2019-RPL3 Trust, Series 2019 RPL3, Klasse B3, 144A, 5,089 %, due 8/1/2057 *	2.972	0,19
7.116	CSMC 2019-RPL3 Trust, Series 2019 RPL3, Klasse B4, 144A, 5,089 %, due 8/1/2057 *	7.725	0,50
9.802	CSMC Mortgage-Backed Trust 2006 - 7, Serie 2006 7, Klasse 11A2, 4,355 %, due 8/25/2036 *†	2.965	0,19
334	CSMC Resecuritization Trust 2006 - 1R, Serie 2006 1R, Klasse 1A2, 144A, 13,641 %, due 7/27/2036 *	432	0,03
5.011	CSMC-Serie 2015-2R, Series 2015 2R, Klasse 7A2, 144A, 3,843 %, due 8/27/2036 *	4.290	0,28
4.342	CSMC Trust 2013-IVR5, Series 2013 IVR5, Klasse B5, 144A, 3,652 %, due 10/25/2043 *	3.635	0,24
11.730	CSMC Trust 2019-CHOP, Series 2019 USA, Klasse F, 144A, 6,545 %, due 7/15/2032 *	11.798	0,76
4.400	CSMC Trust 2019-CHOP, Series 2019 USA, Klasse A2, 144A, 9,815 %, due 7/15/2032 *	4.406	0,29
27.991	CSMC Trust 2018-J1, Series 2018 J1, Klasse B7, 144A, 144A 12,333 %, due 2/25/2048	38.141	2,47
-	CSMC Trust 2018-J1, Series 2018 J1, Klasse A1, 144A, 144A 0,000 %, due 2/25/2048	-	-
7.000	CSWF 2018-TOP, Serie 2018 TOP, Klasse D, 144A, 3,995 %, due 8/15/2035 *	7.012	0,45
1.694	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-AR4, Series 2004 AR4, Klasse 2A2B * 2,602 %, due 1/19/2045 *	1.300	0,08
4.017	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-AR3, Series 2005 AR3, Klasse 2A1B * 2,422 %, due 7/19/2045 *	3.915	0,25
3.786	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-AR5, Series 2005 AR5, Klasse 2A1B * 2,522 %, due 9/19/2045 *	3.592	0,23
696	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Klasse 2A1B * 2,362 %, due 4/19/2047 *	641	0,04
7.369	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C01, Klasse 1B, 13,895 %, due 8/25/2028 *	10.708	0,69
3.676	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C02, Klasse 1B, 14,395 %, due 9/25/2028 *	5.345	0,35
2.954	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C03, Klasse 1B, 13,895 %, due 10/25/2028 *	4.223	0,27
6.913	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C04, Klasse 1B, 12,395 %, due 1/25/2029 *	9.275	0,60
7.929	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C06, Klasse 1B, 11,395 %, due 4/25/2029 *	10.204	0,66
3.500	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2019 C01, Klasse 1B1, 8,016 %, due 7/25/2029 *	4.175	0,27
2.550	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2019 C05, Klasse 1B1, 5,745 %, due 1/25/2030 *	2.666	0,17
8.696	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2019 C05, Klasse 1M2C, 4,345 %, due 1/25/2030 *	8.682	0,56
6.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2019 C06, Klasse 1B1, 6,295 %, due 2/25/2030 *	6.457	0,42
2.490	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2019 C07, Klasse 1M2, 4,545 %, due 5/28/2030 *	2.518	0,16
5.050	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1B1, 5,695 %, due 7/25/2030 *	5.245	0,34
7.560	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1B1, 5,895 %, due 10/25/2030 *	7.916	0,51
3.426	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1M2C, 4,295 %, due 10/25/2030 *	3.397	0,22
13.588	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C05, Klasse 1B1, 6,395 %, due 1/25/2031 *	14.610	0,95
7.750	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C06, Klasse 1B1, 5,895 %, due 3/25/2031 *	8.128	0,53
1.389	Fannie Mae REMICS, 2005-4, Series 2016 60, Klasse M3, 3,955 %, due 9/25/2046	235	0,02
4.003	Fannie Mae REMICS, 2005-4, Series 2019 85, Klasse M3, 4,055 %, due 11/25/2047	685	0,04
6.605	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K038, Klasse X3, 2.568 %, Due 6/25/2042 *	694	0,05
19.370	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K052, Klasse X3, 1.668 %, Due 1/25/2044 *	1.731	0,11
9.000	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, Serie 2019 DNA1, Klasse F, 144A, 13,016 %, due 1/25/2049 *	10.810	0,70
5.250	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2, Serie 2019 DNA2, Klasse F, 144A, 12,645 %, due 3/25/2049 *	6.181	0,40

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
4.600	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 OPT 1. Cla ss 144A. 5,395 %, due 7/25/2049 *	4.697	0,30
6.100	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Klasse F, 144A, 10,295 %, due 7/25/2049 *	6.802	0,44
4.963	Freddie Mac Strukturiert Kreditrisikorisiko Der Agentur Notes, Series 2016 DNA1, Klasse B 12,266 %, due 7/25/2028 *	6.734	0,44
2.522	Freddie Mac Strukturiert Kreditrisikorisiko Der Agentur Notes, Series 2016 DNA2, Klasse B 12,645 %, due 10/25/2028 *	3.491	0,23
2.566	Freddie Mac Strukturiert Kreditrisikorisiko Der Agentur Notes, Series 2016 DNA3, Klasse B 13,395 %, due 12/25/2028 *	3.602	0,23
5.534	Freddie Mac Strukturiert Kreditrisikorisiko Der Agentur Notes, Series 2016 DNA4, Klasse B 10,745 %, due 3/25/2029 *	7.064	0,46
6.996	Freddie Mac Strukturiert Kreditrisikorisiko Der Agentur Notes, Series 2019 DNA2, Klasse B2, 13,395 %, due 10/25/2029 *	8.835	0,57
6.947	Freddie Mac Strukturiert Kreditrisikorisiko Der Agentur Notes, Series 2019 HRP1, Klasse B2D, 5,145 %, due 12/25/2042 *	4.218	0,27
5.500	Freddie Mac Strukturiert Kreditrisikorisiko Der Agentur Notes, Series 2018 SPI1, Klasse 144A, 3,741 %, due 2/25/2048 *	3.512	0,23
14.390	Freddie Mac Strukturiert Kreditrisikorisiko Der Agentur Notes, Series 2018 SPI3, Klasse 144A, 4,161 %, due 8/25/2048 *	8.573	0,55
5.710	CD Commercial Mortgage Trust, Series 2015 K48, Klasse A4 Klasse 144A, 3,762 %, due 8/25/2048 *	6.009	0,39
7.970	CD Commercial Mortgage Trust, Series 2015 K49, Klasse A4 Klasse 144A, 3,848 %, due 10/25/2048 *	8.422	0,54
10.075	CD Commercial Mortgage Trust, Series 2016 K55, Klasse A4 Klasse 144A, 4,296 %, due 4/25/2049 *	10.936	0,71
6.260	CD Commercial Mortgage Trust, Series 2019 K62, Klasse A4 Klasse 144A, 4,004 %, due 1/25/2050 *	6.695	0,43
7.500	CD Commercial Mortgage Trust, Series 2018 K732, Klasse A4 Klasse 144A, 4,194 %, due 5/25/2025 *	7.981	0,52
31.480	CD Commercial Mortgage Trust, Series 2018 SB48, Klasse A4 Klasse 144A, 3,677 %, due 2/25/2038 *	22.956	1,48
5.700	GE Commercial Mortgage RAMP Series 2007-C1 Trust, Series 2007 C1, Klasse M7, 5,677 %, due 12/10/2049 *	1.353	0,09
6.379	GE Commercial Mortgage RAMP Series 2007-C1 Trust, Series 2007 C1, Klasse M7, 5,606 %, due 12/10/2049 *	5.371	0,35
778	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2010 102, Klasse M3, 0,010 %, due 6/16/2052 *	-	-
4.882	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2010 13, Klasse M3, 0,000 %, due 11/16/2051 *	4	-
12.445	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2011 127, Klasse M3, 0,333 %, due 3/16/2047 *	137	0,01
38.098	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2011 95, Klasse M3, 0,096 %, due 4/16/2051 *	96	0,01
24.511	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2012 114, Klasse M3, 0,767 %, due 1/16/2053 *	1.136	0,07
20.352	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2013 163, Klasse M3, 1,239 %, due 2/16/2046 *	1.076	0,07
14.191	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2014 16, Klasse M3, 0,728 %, due 6/16/2055 *	516	0,03
11.858	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2014 171, Klasse M3, 0,639 %, due 11/16/2055 *	393	0,03
3.555	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2014 47, Klasse M3, 0,127 %, due 2/16/2048 *	69	-
10.115	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2014 50, Klasse M3, 0,826 %, due 9/16/2055 *	534	0,03
1.114	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2016 135, Klasse M3, 3,903 %, due 10/16/2046 *	251	0,02
1.613	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2016 51, Klasse M3, 3,878 %, due 4/20/2046 *	288	0,02
12.939	Regierung National Hypothekenverband, 2005-4, Series 2018 125, Klasse M3, 4,078 %, due 9/20/2048 *	1.821	0,12
5.722	Greenpoint Mortgage Funding Trust Series 2007-AR2, 2007 AR2, Klasse 2A1, 2,345 %, due 5/25/2037 *	5.691	0,37
28.679	GS Hypothekenpapiere Corp II, Serie 2018 SRP5, Klasse 144A, 8,195 %, due 9/15/2031 *	28.777	1,86
1.250	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26, Serie 2014 OPT 1. Cla ss 144A. 4,668 %, due 11/10/2047 *	1.102	0,07
4.250	GSMSC Reverbrietization Trust 2014-2R, Serie 2014 2R, Klasse 144A, 2,876 %, due 11/26/2037 *	3.875	0,25
6.078	GSR Mortgage Loan Trust LDP 12. Ser ies 2006 1F. Klasse 6A1, 2,545 %, due 2/25/2036 *	1.654	0,11
186	Harborview Mortgage Loan Trust 2004-11, Serie 2004 Klasse 3A3, 2,942 %, due 1/19/2035 *	172	0,01
123	Nelnet Student Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Klasse 2A1A * 2,722 %, due 3/19/2035 *	122	0,01
452	Harborview Mortgage Loan Trust 2005-10, Serie 2005 Klasse 2A1A, 2,492 %, due 11/19/2035 *	436	0,03
901	Lehman Mortgage Trust 2005-2, Series 2005 2, Klasse 2A1A 2,622 %, due 5/19/2035 *	875	0,06
552	Lehman Mortgage Trust 2005-3, Series 2005 3, Klasse 2A1A 2,662 %, due 6/19/2035 *	556	0,04
5.327	Nelnet Student Loan Trust 2005-8, Series 2005 8, Klasse 2A2 * 3,981 %, due 9/19/2035 *	4.980	0,32
883	Harborview Mortgage Loan Trust 2006 - 10, Serie 2006 Klasse 2A1A, 2,362 %, due 11/19/2036 *	888	0,06
12.383	Harborview Mortgage Loan Trust 2006 - 10, Serie 2006 Klasse 2A1B, 2,422 %, due 11/19/2036 *	10.520	0,68
192	Lehman Mortgage Trust 2007-1, Series 2007 1, Klasse 1A4 Klasse 2A, 2,445 %, due 5/25/2037 *	191	0,01
2.168	IMPAC-CMB-Vertrauen Lehman Mortgage Trust 2005-1, Series 2005 1, Klasse M1 2,835 %, due 4/25/2035 *	2.174	0,14
3.443	IMPAC-CMB-Vertrauen Lehman Mortgage Trust 2005-3, Series 2005 3, Klasse A2 2,745 %, due 8/25/2035 *	2.886	0,19
1.755	IMPAC-CMB-Vertrauen Lehman Mortgage Trust 2005-4, Series 2005 4, Klasse 1M1 2,790 %, due 5/25/2035 *	1.699	0,11
2.664	IMPAC-CMB-Vertrauen Lehman Mortgage Trust 2005-7, Series 2005 7, Klasse A1 2,665 %, due 11/25/2035 *	2.476	0,16
2.719	Impac Secured Assets Trust 2004-4, Series 2004 4, Klasse M5, 1,891 %, due 3,795 %, due 2/25/2035 *	2.208	0,14
5.811	Impac Secured Assets Trust 2005-2, Series 2005 2, Klasse A1W, 1,891 %, due 2,395 %, due 3/25/2036 *	5.606	0,36
1.268	Impac Secured Assets Trust 2006-2, Series 2006 2, Klasse A7, 1,891 %, due Klasse 2B, 3,245 %, due 8/25/2036 *	1.231	0,08
1.548	Impac Secured Assets Trust 2006-2, Series 2006 2, Klasse A7, 1,891 %, due Klasse 2M3, 3,245 %, due 8/25/2036 *	1.568	0,10
15.017	Impac Secured Assets Trust 2006-3, Series 2006 3, Klasse A7, 1,891 %, due Klasse A1, 2,315 %, due 11/25/2036 *	14.399	0,93
9.774	Impac Secured Assets Trust 2006-3, Series 2006 3, Klasse A7, 1,891 %, due Klasse A7, 2,415 %, due 11/25/2036 *	7.604	0,49
294	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-AR7, Series 2004 AR7, Klasse A2 * 3,005 %, due 9/25/2034 *	289	0,02
979	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-AR13, Series 2005 AR13, Klasse 1A1 * 4,114 %, due 8/25/2035 *	807	0,05
1.272	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-AR2, Series 2005 AR2, Klasse 2A1B * 2,925 %, due 2/25/2035 *	619	0,04
3.105	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-AR6, Series 2005 AR6, Klasse 2A2 * 2,805 %, due 4/25/2035 *	2.421	0,16
2.250	JP Morgan Chase Kommerzielle Hypothek Securities Trust 2019-FL11, Serie 2019 FL11, Klasse F, 144A 7,515 %, due 10/15/2032 *	2.219	0,14
3.000	JP Morgan Chase Kommerzielle Hypothek Securities Trust 2018-ASH8, Serie 2018 ASH8, Klasse C, 144A, 3,495 %, due 2/15/2035 *	3.000	0,19

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
24.545	JP Morgan Chase Kommerzielle Hypothek Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Klasse M, 144A, 10,403 %, due 6/15/2035 *	24.493	1,58
1.249	Jp Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-CIBC19, Serie 2007 CB19, Klasse AJ, 6,004 %, due 2/12/2049 *	838	0,05
4.600	Jp Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP10, Serie 2007 C11, Klasse F, 144A, 5,438 %, due 1/15/2049	910	0,06
830	Jp Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust LDP 12. Ser ies 2012 C8. Klasse ER, 144A, 4,807 %, due 10/15/2045 *	827	0,05
59	Jp Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust Series 2015 USA, Klasse E, 144A, 3,742 %, due 9/5/2032 *	59	-
721	Jp Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust Series 2015 USA, Klasse F, 144A, 3,742 %, due 9/5/2032 *	720	0,05
5.134	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2007-S3, Series 2007 S3, Klasse AF3 Klasse 1A18, 2,645 %, due 8/25/2037 *	2.634	0,17
5.752	Jp Morgan Mortgage Trust 2013-2, Serie 2013 2, Klasse B5, 144A, 3,644 %, due 5/25/2043 *	4.835	0,31
86.795	Jp Morgan Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Klasse AX1, 144A, 0,290 %, due 10/25/2048 *†	906	0,06
87.132	JP MORGAN HYPOTHEK Trust 2018-5, Serie 2018 5, Klasse AX1, 144A, 0,338 %, due 10/25/2048 *†	1.093	0,07
7.287	JP MORGAN HYPOTHEK Trust 2018-5, Serie 2018 5, Klasse B3, 144A, 3,838 %, due 10/25/2048 *	7.664	0,50
4.435	JP MORGAN HYPOTHEK Trust 2018-5, Serie 2018 5, Klasse B4, 144A, 3,838 %, due 10/25/2048 *	4.438	0,29
1.952	JP MORGAN HYPOTHEK Trust 2018-5, Serie 2018 5, Klasse B5, 144A, 3,838 %, due 10/25/2048 *	1.571	0,10
3.231	JP MORGAN HYPOTHEK Trust 2018-5, Serie 2018 5, Klasse B6, 144A, 3,838 %, due 10/25/2048 *	1.892	0,12
5.420	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C25, Series 2014 C25, Klasse A1, 144A, 4,092 %, due 11/15/2047 *	4.914	0,32
5.000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Serie 2019 BOLT, Klasse C, 144A, 5,995 %, due 7/15/2034 *	5.009	0,32
12.608	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Serie 2019 BOLT, Klasse D, 144A, 8,745 %, due 7/15/2034 *	12.639	0,82
20.000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Serie 2019 BOLT, Klasse XCP, 144A, 2,052 %, due 7/15/2034 *	750	0,05
1.328	LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2006-C6, Series 2006 C7, Klasse AM * BNK 8. Cla ss XA. 5,452 %, due 9/15/2039 *	792	0,05
11.519	Lone Star Portfolio Trust LDP 10. Ser ies 2015 LDP X. Klasse ER, 144A, 8,045 %, due 9/15/2028 *	11.635	0,75
3.074	LSTAR Securities Investment Trust 2018-2, Serie 2018 2, Klasse A2, 144A, 4,730 %, due 4/1/2023 *	3.083	0,20
558	MASTR Adjustable Rate Hypotheken Trust 2004-14, 2005-4, Series 2004 14, Klasse M2, 3,645 %, due 1/25/2035 *	564	0,04
24	MASTR Adjustable Rate Hypotheken Trust 2004-15, 2005-4, Series 2004 15, Klasse 6A1, 2,475 %, due 12/25/2034 *	23	-
2.120	MASTR Adjustable Rate Hypotheken Trust 2004-6, 2005-4, Series 2004 6, Klasse B1, 4,325 %, due 7/25/2034 *	2.082	0,14
1.383	MASTR Adjustable Rate Hypotheken Trust 2004-8, 2005-4, Series 2004 8, Klasse B1, 4,490 %, due 9/25/2034 *	1.095	0,07
2.725	SLM Student Loan Trust, Series 2006 6, Klasse 1A1, 3.281 % due 12/25/2046 *	4.221	0,27
940	MASTR-Darlehen erneut ausführen Vertrauen 2005-1, Serie 2005 1, Klasse 1A1, 144A, 6,000 %, due 8/25/2034	914	0,06
1.171	MASTR-Darlehen erneut ausführen Vertrauen 2005-2, Serie 2005 2, Klasse 1A1F, 144A, 2,495 %, due 5/25/2035 *	838	0,05
954	MI-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJ, 5,450 %, due 8/12/2048 *	608	0,04
470	MI-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJFL, 144A 5,450 %, due 11/6/2018 *	300	0,02
5.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, Series 2016 C32, Klasse D, 144A, 3,396 %, due 12/15/2049 *	4.235	0,27
13	Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2007 IQ13, Klasse AJ * 5,438 %, due 3/15/2044	13	-
2.250	Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2014 150E, Klasse AJ * 4,438 %, due 11/6/2018 *	2.434	0,16
3.554	Morgan Stanley Hypothek Loan Trust 2004-11AR, 2004 11AR, Klasse 1B1, 2,745 %, due 1/25/2035 *	3.244	0,21
4.201	Morgan Stanley Hypothek Loan Trust 2006-8AR, 2006 8AR, Klasse 1A3, 2,465 %, due 6/25/2036 *	1.644	0,11
11.006	Motel 6 Trust 2019-MTL6, Series 2019 MTL6, Klasse A1, 144A, 3,385 %, due 8/15/2034 *	11.017	0,71
7.115	Motel 6 Trust 2019-MTL6, Series 2019 USA, Klasse F, 144A, 6,445 %, due 8/15/2034 *	7.176	0,46
14.250	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse D, 144A 4,544 %, due 8/5/2024 *	14.002	0,91
4.750	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019, Klasse E, 144A, 4,544 %, due 8/5/2024 *	4.314	0,28
4.287	Nomura Recuritization Trust 2015-4R, Serie 2015 4R, Klasse 4A7, 144A, 4,212 %, due 3/26/2037 *	4.464	0,29
3.140	One Market Plaza Trust 2019-1MKT, Serie 2019 1MKT, Klasse 144A, 4,146 %, due 2/10/2032	3.247	0,21
109	Opteum Hypothek Acceptance Corp Trust 2006-1, Serie 2006 1, Klasse M1, 2,515 %, due 4/25/2036 *	1.700	0,11
2.805	Prime Mortgage Trust Series 2006 DR1, Klasse 2A1, 144A, 5,500 %, due 5/25/2035	2.432	0,16
7.760	Radnor Re 2018-1 Ltd, Series 2018 3A, Klasse M2, 144A 4,845 %, due 3/25/2028 *	7.808	0,50
1.179	RAMP Series 2006-QA2 Trust, Series 2006 QA2, Klasse 1A1, 2,395 %, due 2/25/2036 *	910	0,06
9.101	RBSGC Mortgage Loan Trust 2007-A, Serie 2007 A, Klasse 3A1, 2,495 %, due 1/25/2037 *	3.131	0,20
2.431	Reperforming Loan REMIC Trust 2006-R2, Serie 2006 Klasse AF1, 144A, 2,565 %, due 7/25/2036 *	2.331	0,15
5.238	Wohnanlage Securitization Trust 2006-LDP 12. Ser ies 2006 A7CB. Klasse 1A3, 6,250 %, due 7/25/2036	5.535	0,36
13.604	Gewürzter Credit Risk Transfer Trust 2019-4, Serie 2019 4, Klasse B, 144A, 0,000 %, due 6/25/2057 †	2.841	0,18
20.509	Gewürzter Credit Risk Transfer Trust 2019-4, Serie 2019 4, Klasse BIO, 144A, 1,907 %, due 6/25/2057 *†	4.299	0,28
6.190	Gewürzter Credit Risk Transfer Trust 2019-4, Serie 2019 4, Klasse M, 144A, 4,750 %, due 6/25/2057 *	6.376	0,41
4.577	Serie 2016-1 Für Den Gewürzten Credit Risk Transfer Trust, 2005-4, Series 2016 1, Klasse M3, 0,000 %, due 9/25/2055 †	409	0,03
10.877	Serie 2016-1 Für Den Gewürzten Credit Risk Transfer Trust, Serie 2016 1, Klasse BIO, 144A 1,296 %, due 9/25/2055 *†	1.284	0,08
9.640	Serie 2016-1 Für Den Gewürzten Credit Risk Transfer Trust, Series 2016 3A, Klasse M2, 144A, 3,750 %, due 9/25/2055 *	9.196	0,60
80.384	Serie 2016-1 Für Den Gewürzten Credit Risk Transfer Trust, Serie 2016 1, Klasse XSIO, 144A 0,075 %, due 9/25/2055 *†	287	0,02
13.736	Serie 2019-2 Für Den Gewürzten Credit Risk Transfer Trust, 2005-4, Series 2019 2, Klasse M3, 0,000 %, due 8/25/2056 †	2.108	0,14
22.721	Serie 2019-2 Für Den Gewürzten Credit Risk Transfer Trust, Serie 2019 2, Klasse BIO, 144A 1,155 %, due 8/25/2056 *†	2.927	0,19
5.710	Serie 2019-2 Für Den Gewürzten Credit Risk Transfer Trust, Series 2019 3A, Klasse M1, 144A, 144A 4,000 %, due 8/25/2056 *	5.760	0,37
4.457	Serie 2019-2 Für Den Gewürzten Credit Risk Transfer Trust, Series 2019 3A, Klasse M2, 144A, 4,000 %, due 8/25/2056 *	4.317	0,28
607.908	Serie 2019-2 Für Den Gewürzten Credit Risk Transfer Trust, Serie 2019 2, Klasse XSIO, 144A 0,075 %, due 8/25/2056 *†	2.457	0,16

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inven-tar-werts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
6.500	Serie 2019-3 Des Trusts Für Den Transfer Von Kreditrisiken, Series 2019 3A, Klasse M2, 144A, 4,750 %, due 7/25/2056 *	6.602	0,43
2.457	Erfahrene Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1, 2005-4, Series 2018 1, Klasse M3, 4,750 %, due 5/25/2057 *	2.495	0,16
13.371	Erfahrene Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2, 2005-4, Series 2018 2, Klasse M3, 4,750 %, due 11/25/2057	13.552	0,88
16.862	Erfahrene Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3, Serie 2018 3, Klasse BX, 144A 2,817 %, due 8/25/2057 *	5.747	0,37
11.630	Erfahrene Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3, 2005-4, Series 2018 3, Klasse M3, 4,750 %, due 8/25/2057 *	12.022	0,78
14.332	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Klasse E, 144A, 6,345 %, due 11/15/2027 *	11.911	0,77
2.899	Stonemont Portfolio Trust 2019-STONE, Serie 2019, MONT-KLASSE F, 144A, 5,772 %, due 8/20/2030 *	2.910	0,19
9.017	Strukturierter, Anpassbarer Zinssatz Mortgage Loan Trust RAMP Series 2005-19XS Trust, Series 2005 19XS, Klasse 1A2B * 2,505 %, due 10/25/2035 *	8.661	0,56
872	Strukturiertes, Anpassbares Hypothekenkreditgeschäft, 2005-4, Series 2004 2, Klasse 1A1, 5,170 %, due 3/25/2034 *	882	0,06
1.770	Strukturiertes, Anpassbares Hypothekenkreditgeschäft, 2005 8XS, Klasse M1, 2,790 %, due 4/25/2035 *	1.715	0,11
5.243	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5, Serie 2006 AR5, Klasse 4A1, 2,365 %, fällig am 5/25/2046 *	2.986	0,19
96	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Klasse 1A1, 2,325 %, fällig 7/25/2046 *	90	0,01
1.215	Tharaldson Hotel Portfolio Series 2018 USA, Klasse E, 144A, 5,403 %, due 11/11/2034 *	1.220	0,08
8.911	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Klasse G, 144A, 8,573 %, due 11/11/2034 *	9.059	0,59
9.883	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Klasse H, 144A, 12,023 %, due 11/11/2034 *	10.059	0,65
3.873	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust, Series C29 Serie 2007-C33, Serie 2007 C33, Klasse AJ, 5,844 %, due 2/15/2051 *	3.364	0,22
3.768	WaMu Hypothekenpass-Über Zertifikate Serie 2005-AR11 Trust, 2005 AR11, Klasse B1, 2,755 %, due 8/25/2045 *	3.526	0,23
1.253	WaMu Hypothekenpass-Über Zertifikate Serie 2005-AR15 Trust, LDP 12. Ser ies 2005 AR15. Klasse A1C4, 2,545 %, due 11/25/2045 *	894	0,06
7.735	WaMu Hypothekenpass-Über Zertifikate Serie 2005-AR2 Trust, 2005 AR2, Klasse B1, 2,675 %, due 1/25/2045 *	5.987	0,39
2.753	WaMu Hypothekenpass-Über Zertifikate Serie 2005-AR9 Trust, 2005 AR9, Klasse B1, 3,090 %, due 7/25/2045 *	2.359	0,15
9.344	WaMu Hypothekenpass-Über Zertifikate Serie 2007-OA2 Trust, 2007 OA2, Klasse A1C4, 3,181 %, due 3/25/2047 *	8.654	0,56
30	Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-RA1 Trust, Serie 2005 RA1, Klasse 3A, 4,400 %, due 1/25/2035 *	31	-
1.682	LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Series 2015 SBC5, Klasse AM * 6,527 %, due 9/14/2022 *	1.680	0,11
2.903	Wells Fargo Mortgage Backed Securities 2005-AR7 Trust, Serie 2005 AR7, Klasse B1, 5,093 %, fällig am 5/25/2035 *	2.932	0,19
1.252	LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22, Series 2014 C22, Klasse AM * 4,052 %, due 9/15/2057 *	1.038	0,07
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 1.088,272)		1.117.291	72,23
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 0,01 % 28. Februar 2019 0,01 %)			
Kaimaninseln – 0,01 % (28. Februar 2019: 0,01 %)			
119	DAE Funding LLC, 144A, 7,319 %, due 2/12/2023	121	0,01
USA – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
28	Ambac Assurance Corp, 144A 5,100 %, due 3/6/2019	40	-
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 56)		161	0,01
Loan Notes - 2,45 % 28. Februar 2019 1,95 %)			
30.000	American Dream, 11,363 %, due 6/29/2024 *∞	29.910	1,93
8.000	Palmetto Fachkrankenpflege, 6,470 %, fällig am 11.01.2022 *† ∞	8.000	0,52
Loan Notes insgesamt (Anschaffungskosten USD 1.513)		37.910	2,45
Investmentfonds – 8,99 % (28. Februar 2019: 2,32 %)			
139.042	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (Distributing)	139.042	8,99
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 139.042)		139.042	8,99
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Anschaffungskosten USD 1.513.707)		1.552.386	100,36
Credit Default Swaps – 0,09 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.433	0,09
Swaptions – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		9	-
Devisenterminkontrakte – 0,00 % 28. Februar 2019 0,14 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		59	-
Futures – 0,24 % (28. Februar 2019: 0,02 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		3.712	0,24
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		1.557.599	100,69
Credit Default Swaps – (0,17 %) (28. Februar 2019: 0,15 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(2.626)	(0,17)
Devisenterminkontrakte – (0,55 %) 28. Februar 2019 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(8.571)	(0,55)
Futures – (0,19 %) (28. Februar 2019: 0,04 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(2.921)	(0,19)
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten		(14.118)	(0,91)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		1.543.481	99,78
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		3.298	0,22
Nettovermögen insgesamt		USD 1.546.779	100,00

– Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2018 beliefen sich diese Wertpapiere auf 66.000 USD und machten 54,28 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2018.

† Illiquide.

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

ABKÜRZUNGEN:

REMIC - Real Estate Mortgage Investment Conduit

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,90
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	2,40
Investmentfonds	8,78
Derivate	0,33
Sonstige Vermögenswerte	1,59
Gesamtvermögen	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kauf/Verkauf Schutz	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Barclays	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	05.11.63	2.000	USD (192)
Barclays	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	05.11.63	4.000	(385)
Barclays	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	10.17.57	1.700	(89)
Barclays	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	05.11.63	1.300	(125)
Barclays	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	10.17.57	2.300	(120)
Barclays	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	05.11.63	2.300	(221)
Barclays	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Kauf	8.17.61	4.000	315
Barclays	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Kauf	11.18.54	2.300	124
Barclays	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	05.11.63	2.600	(250)
Credit Suisse	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Kauf	11.18.54	3.900	210
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Kauf	8.17.61	7.700	606
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Kauf	11.18.54	3.300	178
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	05.11.63	3.300	(318)
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	10.17.57	5.000	(260)
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	10.17.57	2.000	(104)
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	10.17.57	7.700	(401)
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	10.17.57	1.200	(62)
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3.000 %	Verkauf	10.17.57	1.900	(99)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD–)					USD 1.433
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD (1.781))					(2.626)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD (1.781))					USD (1.193)

Aufstellung der Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Wirksamkeitsdatum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Credit Suisse	Swaption Payer Strike 0.70 %	19.9.19	56.875	USD 9
Nicht realisierte Wertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD–)				9
Nicht realisierte Wertminderung von Swaptions (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD–)				-
Nettowertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD–)				USD 9

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.409	Verkauf	EUR	2.175	USD 19
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	89	Verkauf	USD	108	-
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.533	Verkauf	USD	1.697	(13)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	AUD	1	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	3.511	Verkauf	EUR	3.154	40
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	321	Verkauf	GBP	264	(1)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	108	Verkauf	GBP	89	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	33.239	Verkauf	USD	40.480	(17)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	53	Verkauf	USD	64	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	410.335	Verkauf	USD	459.861	(8.522)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CHF	1.038	Verkauf	USD	1.067	(17)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	120	Verkauf	USD	82	(1)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD 1.706)								59
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD (131))								(8.571)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD 1.575								USD (8.512)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nenn-wert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro$ June 2020	2.304	USD 567.965	USD 1.838
90 Day Euro$ March 2020	(17)	(4.184)	(73)
90 Day Euro$ September 2020	(17)	(4.195)	(84)
U.S. 10 Year Note (CBT) March 2019	(3.187)	(419.788)	(1.722)
10 Jahre Ultra Note Dezember 2019 in den USA	(1.938)	(279.920)	(829)
U.S. 2 Year Note (CBT) March 2019	(517)	(111.732)	(2)
U.S. 5 Year Note (CBT) March 2019	(682)	(81.824)	(211)
U.S. Long Bond (CBT) March 2019	1.058	174.834	1.302
U.S. Ultra Bond (CBT) March 2019	272	53.703	572
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2017 (in Tsd.): 244 US-Dollar)			USD 3.712
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD (437))			(2.921)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2017 (in Tsd.): USD (193))			USD 791

^ *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^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Asset-Backed Securities - 1,13 % (28. Februar 2019: 0,18 %)			
9.500	Nelnet Student Loan Trust 2007-1, Series 2007 1, Klasse A4, 2,242 %, due 8/27/2036 *	9.000	0,96
1.484	SBA Small Business Cos, Series 2018 10B, Class 1, 3.548 %, due 9/10/2028	1.593	0,17
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 10.482)		10.593	1,13
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 99,39 % (28. Februar 2019: 100,63 %)			
65.785	BANK 2017-BNK8, Series 2017 BNK8. Class XA. 0,881 %, due 11/15/2050 *	3.392	0,36
4.400	BANK 2018-BNK10, Series 2018 BN10, Class A5, 3,688 %, due 2/15/2061	4.899	0,52
2.210	BENCHMARK 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018 B1, Class A5, 3,666 %, due 1/15/2051 *	2.454	0,26
4.050	BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class A, 144A, 3,445 %, due 7/15/2035 *	4.057	0,43
39.018	CD 2017-CD6 Mortgage Trust, Series 2017 CD6, Class XA, 1,110 %, due 11/13/2050 *	2.166	0,23
5.471	CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3, Class A1, 144A, 4.000 %, due 8/1/2057 *	5.685	0,60
691	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 9, 5,000 %, due 2/25/2041 *	108	0,01
1.382	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse C10, 5,000 %, due 1/25/2038	210	0,02
1.277	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C13, 3,500 %, due 11/25/2041	165	0,02
5.300	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 3,500 % ±	5.493	0,58
300	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 3.000 % ±	308	0,03
22.200	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4.500 % ±	23.376	2,49
1.500	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5.000 % ±	1.602	0,17
8.700	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3.000 % ±	8.873	0,94
1	Fannie Mae Pool ‘252875’, 8.000 %, due 11/1/2029	1	–
1	Fannie Mae Pool ‘253184’, 8.000 %, due 4/1/2030	1	–
–	Fannie Mae Pool ‘253399’, 8.500 %, due 8/1/2030	1	–
–	Fannie Mae Pool ‘253438’, 8.500 %, due 9/1/2030	–	–
1	Fannie Mae Pool ‘253598’, 8.500 %, due 12/1/2030	1	–
189	Fannie Mae Pool ‘254793’, 5.000 %, due 7/1/2033	210	0,02
–	Fannie Mae Pool ‘303157’, 10.000 %, due 5/1/2022	–	–
5.310	Fannie Mae Pool ‘387771’, 3.790 %, due 8/1/2028	5.932	0,63
2.740	Fannie Mae Pool ‘387798’, 3.620 %, due 8/1/2030	3.111	0,33
–	Fannie Mae Pool ‘426874’, 10.000 %, due 11/1/2024	–	–
–	Fannie Mae Pool ‘495792’, 8.500 %, due 5/1/2030	–	–
–	Fannie Mae Pool ‘535270’, 8.500 %, due 4/1/2030	1	–
21	Fannie Mae Pool ‘535299’, 7.500 %, due 5/1/2030	24	–
2	Fannie Mae Pool ‘535332’, 8.500 %, due 4/1/2030	2	–
–	Fannie Mae Pool ‘535351’, 8.000 %, due 6/1/2030	–	–
–	Fannie Mae Pool ‘535435’, 8.500 %, due 8/1/2030	–	–
2	Fannie Mae Pool ‘535608’, 9.500 %, due 4/1/2030	2	–
8	Fannie Mae Pool ‘535996’, 7.500 %, due 6/1/2031	10	–
–	Fannie Mae Pool ‘537715’, 8.500 %, due 9/1/2030	–	–
2	Fannie Mae Pool ‘541735’, 8.000 %, due 6/1/2030	2	–
45	Fannie Mae Pool ‘545189’, 7.500 %, due 8/1/2031	52	0,01
36	Fannie Mae Pool ‘545190’, 7.500 %, due 8/1/2031	41	–
3	Fannie Mae Pool ‘545612’, 8.000 %, due 4/1/2032	4	–
4	Fannie Mae Pool ‘545990’, 7.500 %, due 4/1/2031	5	–
–	Fannie Mae Pool ‘546591’, 8.500 %, due 6/1/2030	–	–
5	Fannie Mae Pool ‘548965’, 8.500 %, due 7/1/2030	6	–
21	Fannie Mae Pool ‘555676’, 7.500 %, due 12/1/2032	24	–
231	Fannie Mae Pool ‘555743’, 5.000 %, due 9/1/2033	257	0,03
60	Fannie Mae Pool ‘727181’, 5.000 %, due 8/1/2033	66	0,01
50	Fannie Mae Pool ‘735578’, 5.000 %, due 6/1/2035	56	0,01
34	Fannie Mae Pool ‘745248’, 7.500 %, due 8/1/2034	39	–
1.026	Fannie Mae Pool ‘745580’, 5.000 %, due 6/1/2036	1.143	0,12
240	Fannie Mae Pool ‘745802’, 6.000 %, due 7/1/2036	278	0,03
22	Fannie Mae Pool ‘745959’, 5.500 %, due 11/1/2036	25	–
353	Fannie Mae Pool ‘836390’, 5.000 %, due 10/1/2035	393	0,04
1.106	Fannie Mae Pool ‘836398’, 4.403 %, due 10/1/2035 *	1.144	0,12
23	Fannie Mae Pool ‘836852’, 4.367 %, due 10/1/2035 *	24	–
25	Fannie Mae Pool ‘843823’, 4.411 %, due 11/1/2035 *	25	–
347	Fannie Mae Pool ‘843997’, 4.458 %, due 11/1/2035 *	359	0,04
101	Fannie Mae Pool ‘865915’, 4.606 %, due 3/1/2036 *	103	0,01
305	Fannie Mae Pool ‘888218’, 5.000 %, due 3/1/2037	339	0,04
24	Fannie Mae Pool ‘889117’, 5.000 %, due 10/1/2035	27	–
942	Fannie Mae Pool ‘890345’, 5.000 %, due 6/1/2041	1.038	0,11
1.416	Fannie Mae Pool ‘890604’, 4.500 %, due 10/1/2044	1.541	0,16
5.222	Fannie Mae Pool ‘890813’, 3.500 %, due 12/1/2047	5.470	0,58
95	Fannie Mae Pool ‘890876’, 3.500 %, due 2/1/2049	100	0,01
27	Fannie Mae Pool ‘902663’, 6.000 %, due 11/1/2036	31	–
14	Fannie Mae Pool ‘909856’, 6.000 %, due 3/1/2037	16	–
590	Fannie Mae Pool ‘934231’, 5.000 %, due 1/1/2039	652	0,07
173	Fannie Mae Pool ‘961907’, 5.000 %, due 3/1/2038	191	0,02
1.102	Fannie Mae Pool ‘962687’, 5.000 %, due 4/1/2038	1.223	0,13
25	Fannie Mae Pool ‘973013’, 4.500 %, due 3/1/2038	27	–
1	Fannie Mae Pool ‘974763’, 4.500 %, due 4/1/2038	1	–
42	Fannie Mae Pool ‘981766’, 4.500 %, due 4/1/2038	45	0,01
9	Fannie Mae Pool ‘995072’, 5.500 %, due 8/1/2038	11	–
1.172	Fannie Mae Pool ‘995948’, 5.000 %, due 3/1/2039	1.300	0,14
130	Fannie Mae Pool ‘AA8438’, 4.500 %, due 6/1/2039	141	0,02
112	Fannie Mae Pool ‘AB0129’, 5.000 %, due 4/1/2035	121	0,01
1.120	Fannie Mae Pool ‘AB0131’, 5.000 %, due 12/1/2038	1.246	0,13
40	Fannie Mae Pool ‘AB2725’, 5.500 %, due 4/1/2041	44	0,01
38	Fannie Mae Pool ‘AB2817’, 5.000 %, due 4/1/2041	42	–
2.343	Fannie Mae Pool ‘AB3882’, 4.500 %, due 11/1/2041	2.539	0,27
1.144	Fannie Mae Pool ‘AB5692’, 4.000 %, due 6/1/2042	1.218	0,13
1.395	Fannie Mae Pool ‘AB7453’, 2.500 %, due 1/1/2028	1.420	0,15
97	Fannie Mae Pool ‘AB7668’, 3.000 %, due 1/1/2043	100	0,01
494	Fannie Mae Pool ‘AB8144’, 5.000 %, due 4/1/2037	551	0,06
337	Fannie Mae Pool ‘AB9107’, 3.500 %, due 4/1/2033	351	0,04
67	Fannie Mae Pool ‘AC2389’, 5.000 %, due 2/1/2037	75	0,01
27	Fannie Mae Pool ‘AC7479’, 5.500 %, due 3/1/2040	29	–
2.230	Fannie Mae Pool ‘AD1645’, 5.000 %, due 3/1/2040	2.466	0,26
155	Fannie Mae Pool ‘AD2963’, 5.000 %, due 4/1/2040	171	0,02
44	Fannie Mae Pool ‘AD3336’, 5.500 %, due 4/1/2040	48	0,01
24	Fannie Mae Pool ‘AD3515’, 5.500 %, due 4/1/2040	26	–
28	Fannie Mae Pool ‘AD3796’, 5.000 %, due 4/1/2040	31	–
7	Fannie Mae Pool ‘AD4567’, 5.500 %, due 4/1/2040	8	–
5	Fannie Mae Pool ‘AD4598’, 5.500 %, due 5/1/2040	6	–
13	Fannie Mae Pool ‘AD4614’, 5.500 %, due 6/1/2040	14	–
137	Fannie Mae Pool ‘AD4898’, 5.000 %, due 5/1/2040	146	0,02
11	Fannie Mae Pool ‘AD8281’, 5.500 %, due 7/1/2040	12	–
101	Fannie Mae Pool ‘AD8326’, 5.500 %, due 7/1/2040	111	0,01
172	Fannie Mae Pool ‘AD8642’, 5.500 %, due 8/1/2040	189	0,02
88	Fannie Mae Pool ‘AD9893’, 5.500 %, due 7/1/2040	97	0,01
25	Fannie Mae Pool ‘AE0758’, 7.000 %, due 2/1/2039	30	–
60	Fannie Mae Pool ‘AE1592’, 5.500 %, due 9/1/2040	65	0,01
18	Fannie Mae Pool ‘AE4513’, 5.500 %, due 2/1/2041	20	–
390	Fannie Mae Pool ‘AH4029’, 5.000 %, due 4/1/2041	429	0,05
261	Fannie Mae Pool ‘AH5036’, 5.500 %, due 2/1/2041	290	0,03
54	Fannie Mae Pool ‘AH8309’, 5.000 %, due 4/1/2041	57	0,01
17	Fannie Mae Pool ‘AH9785’, 5.500 %, due 4/1/2041	18	–
69	Fannie Mae Pool ‘AI0199’, 5.000 %, due 4/1/2041	74	0,01
39	Fannie Mae Pool ‘AI2249’, 5.500 %, due 8/1/2041	42	–
28	Fannie Mae Pool ‘AI9532’, 5.500 %, due 9/1/2041	30	–
17	Fannie Mae Pool ‘AJ2033’, 5.500 %, due 10/1/2041	19	–
110	Fannie Mae Pool ‘AJ4713’, 4.500 %, due 11/1/2041	119	0,01
104	Fannie Mae Pool ‘AL0521’, 5.000 %, due 6/1/2041	116	0,01
350	Fannie Mae Pool ‘AL1051’, 4.500 %, due 9/1/2041	379	0,04
994	Fannie Mae Pool ‘AL1469’, 7.000 %, due 2/1/2039	1.191	0,13
495	Fannie Mae Pool ‘AL1470’, 7.000 %, due 4/1/2037	604	0,06
10.117	Fannie Mae Pool ‘AL3024’, 3.500 %, due 1/1/2043	10.588	1,13
76	Fannie Mae Pool ‘AL3026’, 3.500 %, due 12/1/2042	80	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^

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
2.895	Fannie Mae Pool 'AL4324', 6.500 %, due 5/1/2040	3.412	0,36
350	Fannie Mae Pool 'AL4741', 4.500 %, due 1/1/2044	377	0,04
11.004	Fannie Mae Pool 'AL7093', 4.000 %, due 5/1/2045	12.004	1,28
2.214	Fannie Mae Pool 'AL7877', 4.000 %, due 12/1/2045	2.338	0,25
2.353	Fannie Mae Pool 'AN3701', 2.720 %, due 11/1/2026	2.474	0,26
2.893	Fannie Mae Pool 'AN5318', 3.230 %, due 4/1/2027	3.123	0,33
1.933	Fannie Mae Pool 'AN5951', 2.740 %, due 7/1/2027	2.035	0,22
4.530	Fannie Mae Pool 'AN5953', 2.740 %, due 7/1/2027	4.768	0,51
2.878	Fannie Mae Pool 'AN6208', 2.995 %, due 7/1/2027	3.049	0,32
1.980	Fannie Mae Pool 'AN6534', 2.950 %, due 7/1/2027	2.120	0,23
2.614	Fannie Mae Pool 'AN6798', 3.080 %, due 9/1/2029	2.838	0,30
4.610	Fannie Mae Pool 'AN8048', 3.080 %, due 1/1/2028	4.958	0,53
3.460	Fannie Mae Pool 'AN9493', 3.750 %, due 6/1/2030	3.951	0,42
1.160	Fannie Mae Pool 'AN9585', 3.550 %, due 8/1/2028	1.297	0,14
365	Fannie Mae Pool 'AO4102', 4.000 %, due 6/1/2042	389	0,04
1.325	Fannie Mae Pool 'AP9633', 2.500 %, due 10/1/2042	1.338	0,14
1.038	Fannie Mae Pool 'AP9766', 4.000 %, due 10/1/2042	1.103	0,12
3.053	Fannie Mae Pool 'AQ6295', 3.500 %, due 12/1/2032	3.180	0,34
203	Fannie Mae Pool 'AQ7130', 3.500 %, due 12/1/2032	212	0,02
774	Fannie Mae Pool 'AQ7270', 3.500 %, due 12/1/2032	806	0,09
633	Fannie Mae Pool 'AQ7306', 3.000 %, due 1/1/2043	653	0,07
900	Fannie Mae Pool 'AQ7864', 3.500 %, due 12/1/2032	937	0,10
268	Fannie Mae Pool 'AQ7869', 3.500 %, due 11/1/2032	279	0,03
432	Fannie Mae Pool 'AQ7913', 3.500 %, due 12/1/2032	450	0,05
482	Fannie Mae Pool 'AQ8677', 3.500 %, due 12/1/2032	502	0,05
169	Fannie Mae Pool 'AQ9670', 3.000 %, due 1/1/2043	174	0,02
177	Fannie Mae Pool 'AR1198', 3.000 %, due 1/1/2043	183	0,02
499	Fannie Mae Pool 'AR1202', 3.000 %, due 1/1/2043	515	0,06
59	Fannie Mae Pool 'AR1203', 3.000 %, due 12/1/2042	61	0,01
39	Fannie Mae Pool 'AR4217', 3.000 %, due 1/1/2043	40	–
645	Fannie Mae Pool 'AR6881', 2.500 %, due 2/1/2028	657	0,07
1.208	Fannie Mae Pool 'AS0462', 3.500 %, due 9/1/2033	1.262	0,13
392	Fannie Mae Pool 'AS0469', 4.000 %, due 9/1/2033	417	0,04
225	Fannie Mae Pool 'AS1281', 3.500 %, due 12/1/2033	234	0,03
8.989	Fannie Mae Pool 'AS4347', 4.000 %, due 1/1/2045	9.623	1,02
2.962	Fannie Mae Pool 'AS4363', 4.500 %, due 2/1/2045	3.309	0,35
7.296	Fannie Mae Pool 'AS6328', 3.500 %, due 12/1/2045	7.571	0,81
1.114	Fannie Mae Pool 'AS6340', 3.500 %, due 12/1/2045	1.167	0,12
3.610	Fannie Mae Pool 'AS6396', 3.500 %, due 12/1/2045	3.769	0,40
695	Fannie Mae Pool 'AS6541', 3.500 %, due 1/1/2046	730	0,08
691	Fannie Mae Pool 'AS6562', 3.500 %, due 1/1/2046	724	0,08
5.647	Fannie Mae Pool 'AS7890', 3.000 %, due 9/1/2046	5.823	0,62
837	Fannie Mae Pool 'AS9453', 4.000 %, due 4/1/2047	886	0,09
524	Fannie Mae Pool 'AT2486', 3.500 %, due 6/1/2033	547	0,06
5.388	Fannie Mae Pool 'AT3070', 3.500 %, due 4/1/2043	5.665	0,60
203	Fannie Mae Pool 'AU4395', 4.000 %, due 10/1/2033	218	0,02
117	Fannie Mae Pool 'AU4397', 4.000 %, due 10/1/2033	125	0,01
176	Fannie Mae Pool 'AU7248', 4.000 %, due 10/1/2033	186	0,02
239	Fannie Mae Pool 'AU9562', 4.000 %, due 10/1/2033	253	0,03
242	Fannie Mae Pool 'AU9567', 4.000 %, due 10/1/2033	259	0,03
193	Fannie Mae Pool 'AU9570', 4.000 %, due 10/1/2033	206	0,02
10	Fannie Mae Pool 'AV3286', 5.000 %, due 11/1/2043	11	–
45	Fannie Mae Pool 'AV6366', 4.500 %, due 1/1/2044	48	0,01
66	Fannie Mae Pool 'AV7116', 4.500 %, due 3/1/2044	71	0,01
164	Fannie Mae Pool 'AV7681', 3.500 %, due 1/1/2034	170	0,02
303	Fannie Mae Pool 'AV7683', 3.500 %, due 1/1/2034	318	0,03
508	Fannie Mae Pool 'AV7694', 3.500 %, due 1/1/2034	534	0,06
579	Fannie Mae Pool 'AV7696', 3.500 %, due 1/1/2034	607	0,06
9.172	Fannie Mae Pool 'AY1321', 3.500 %, due 3/1/2035	9.520	1,01
4.998	Fannie Mae Pool 'AZ9645', 4.000 %, due 9/1/2035	5.299	0,56
3.973	Fannie Mae Pool 'BC0830', 3.000 %, due 4/1/2046	4.095	0,44
15.132	Fannie Mae Pool 'BD9284', 3.000 %, due 11/1/2046	15.552	1,65
14.496	Fannie Mae Pool 'BF0145', 3.500 %, due 3/1/2057	15.149	1,61
4.521	Fannie Mae Pool 'BF0161', 5.000 %, due 10/1/2046	4.904	0,52
8.927	Fannie Mae Pool 'BF0162', 5.000 %, due 11/1/2045	9.662	1,03
2.031	Fannie Mae Pool 'BF0191', 4.000 %, due 6/1/2057	2.148	0,23
3.945	Fannie Mae Pool 'BF0222', 4.500 %, due 9/1/2057	4.263	0,45
7.624	Fannie Mae Pool 'BH6684', 4.000 %, due 8/1/2047	8.012	0,85
3.991	Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3.000 %, due 12/1/2037	4.110	0,44
5.753	Fannie Mae Pool 'BJ3620', 4.000 %, due 1/1/2048	6.024	0,64
86	Fannie Mae Pool 'BJ8078', 3,500 %, due 3/1/2048	90	0,01
84	Fannie Mae Pool 'BK0751', 3,500 %, due 3/1/2048	88	0,01
10.192	Fannie Mae Pool 'BK1229', 4.000 %, due 2/1/2048	10.666	1,13
11.409	Fannie Mae Pool 'BM3372', 3.321 %, due 1/1/2028	12.456	1,32
2.178	Fannie Mae Pool 'BM4696', 3.000 %, due 3/1/2047	2.252	0,24
446	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3.500 %, due 3/1/2043	468	0,05
6.648	Fannie Mae Pool 'BM4832', 3.000 %, due 12/1/2047	6.883	0,73
642	Fannie Mae Pool 'BM4897', 3.500 %, due 12/1/2046	671	0,07
1.846	Fannie Mae Pool 'BM5073', 3.000 %, due 4/1/2048	1.907	0,20
1.758	Fannie Mae Pool 'BM5521', 3.500 %, due 7/1/2048	1.830	0,19
587	Fannie Mae Pool 'BN5424', 3.500 %, due 4/1/2049	606	0,06
1.095	Fannie Mae Pool 'BN7777', 3.500 %, due 4/1/2049	1.127	0,12
1.254	Fannie Mae Pool 'BN7783', 3.500 %, due 5/1/2049	1.295	0,14
8.909	Fannie Mae Pool 'BN9760', 3.500 %, due 5/1/2049	9.170	0,98
294	Fannie Mae Pool 'BO0955', 3.500 %, due 6/1/2049	304	0,03
200	Fannie Mae Pool 'BO3074', 3.000 %, due 8/1/2049	204	0,02
3.207	Fannie Mae Pool 'CA0858', 3.500 %, due 12/1/2047	3.327	0,35
355	Fannie Mae Pool 'CA0907', 3.500 %, due 12/1/2047	371	0,04
22.175	Fannie Mae Pool 'CA0917', 3.500 %, due 12/1/2047	23.172	2,46
2.421	Fannie Mae Pool 'CA2652', 5.000 %, due 11/1/2048	2.592	0,28
492	Fannie Mae Pool 'CA3471', 3.500 %, due 5/1/2049	511	0,05
396	Fannie Mae Pool 'CA3478', 3.500 %, due 5/1/2049	409	0,04
1.990	Fannie Mae Pool 'CA3634', 3.500 %, due 6/1/2049	2.079	0,22
1.684	Fannie Mae Pool 'CA3637', 3.500 %, due 6/1/2049	1.739	0,19
1.585	Fannie Mae Pool 'CA3657', 3.500 %, due 6/1/2049	1.648	0,18
1.086	Fannie Mae Pool 'CA3661', 3.500 %, due 6/1/2049	1.121	0,12
8.989	Fannie Mae Pool 'CA3876', 3.500 %, due 7/1/2049	9.250	0,98
999	Fannie Mae Pool 'CA4017', 3.000 %, due 8/1/2049	1.021	0,11
300	Fannie Mae Pool 'CA4078', 3.000 %, due 9/1/2049	306	0,03
1.700	Fannie Mae Pool 'CA4121', 3.000 %, due 9/1/2049	1.748	0,19
4.968	Fannie Mae Pool 'FM1002', 3.500 %, due 1/1/2048	5.190	0,55
200	Fannie Mae Pool 'FM1341', 3.000 %, due 8/1/2049	205	0,02
16	Fannie Mae Pool 'MA0440', 5.500 %, due 5/1/2040	18	–
41	Fannie Mae Pool 'MA0619', 5.500 %, due 11/1/2040	45	0,01
14	Fannie Mae Pool 'MA0706', 4.500 %, due 4/1/2031	15	–
31	Fannie Mae Pool 'MA0734', 4.500 %, due 5/1/2031	33	–
50	Fannie Mae Pool 'MA0766', 5.500 %, due 5/1/2041	56	0,01
15	Fannie Mae Pool 'MA0776', 4.500 %, due 6/1/2031	16	–
235	Fannie Mae Pool 'MA0823', 5.500 %, due 7/1/2041	261	0,03
116	Fannie Mae Pool 'MA0867', 5.500 %, due 9/1/2041	129	0,01
358	Fannie Mae Pool 'MA0913', 4.500 %, due 11/1/2031	384	0,04
472	Fannie Mae Pool 'MA0939', 4.500 %, due 12/1/2031	506	0,05
78	Fannie Mae Pool 'MA0968', 4.500 %, due 12/1/2031	84	0,01
529	Fannie Mae Pool 'MA1177', 3.500 %, due 9/1/2042	554	0,06
41	Fannie Mae Pool 'MA1221', 4.500 %, due 9/1/2042	44	–
110	Fannie Mae Pool 'MA1363', 3.000 %, due 2/1/2043	114	0,01
3.922	Fannie Mae Pool 'MA1393', 4.000 %, due 3/1/2043	4.179	0,44
747	Fannie Mae Pool 'MA1591', 4.500 %, due 9/1/2043	806	0,09
658	Fannie Mae Pool 'MA1629', 4.500 %, due 10/1/2043	710	0,08
453	Fannie Mae Pool 'MA1664', 4.500 %, due 11/1/2043	489	0,05
530	Fannie Mae Pool 'MA1711', 4.500 %, due 12/1/2043	572	0,06
1.617	Fannie Mae Pool 'MA2737', 3.000 %, due 9/1/2046	1.664	0,18
2.553	Fannie Mae Pool 'MA2820', 2.500 %, due 11/1/2031	2.569	0,27
1.442	Fannie Mae Pool 'MA3383', 3.500 %, due 6/1/2048	1.491	0,16
629	Fannie Mae Pool 'MA3501', 5.000 %, due 10/1/2048	672	0,07
2.075	Fannie Mae REMICS, Series 2010 2, Class AI, 5,500 %, due 2/25/2040	352	0,04
4.540	Fannie Mae REMICS, Series 2011 36, Class YS, 4,375 %, due 1/25/2041 *	976	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^

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
4.477	Fannie Mae REMICS, Series 2012 22, Class SM, 4,355 %, due 3/25/2042 *	543	0,06
1.405	Fannie Mae REMICS, Series 2012 9, Class PT, 11,547 %, due 7/25/2036 *	1.792	0,19
1.686	Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class BC, 6,500 %, due 7/25/2042	1.994	0,21
8.282	Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class CB, 5,500 %, due 4/25/2042	9.405	1,00
14.625	Fannie Mae REMICS, Series 2016 48, Class IA, 4,500 %, due 6/25/2038	2.360	0,25
11.929	Fannie Mae REMICS, Series 2019 38, Class SH, 3,784 %, due 7/25/2049 *	2.209	0,24
4.137	Fannie Mae REMICS, Series 2019 42, Class KS, 5,005 %, due 8/25/2049 *	674	0,07
4.411	Fannie Mae REMICS, Series 2019 42, Class LS, 4,505 %, due 8/25/2049 *	724	0,08
5.465	Fannie Mae REMICS, Series 2019 44, Class SM, 3,905 %, due 8/25/2049 *	967	0,10
5.878	Fannie Mae REMICS, Series 2019 45, Class BS, 3,905 %, due 8/25/2049 *	988	0,11
22.514	Fannie Mae REMICS, Series 2019 45, Class SE, 3,905 %, due 8/25/2049 *	4.909	0,52
9.801	Fannie Mae REMICS, Series 2019 5, Class IO, 4,500 %, due 3/25/2049	1.755	0,19
5.400	Fannie Mae REMICS, Series 2019 54, Class SA, 3.880 %, due 9/25/2049 *∞	1.023	0,11
1.858	Fannie Mae-Aces, Series 2016 M11, Class AL, 2,944 %, due 7/25/2039	1.952	0,21
21.913	Fannie Mae-Aces, Series 2019 M11, Class X1, 1,168 %, due 6/25/2029 *	1.824	0,19
96	Freddie Mac Gold Pool ‘A29586’, 5.000 %, due 1/1/2035	107	0,01
32	Freddie Mac Gold Pool ‘A30703’, 5.500 %, due 12/1/2034	34	–
200	Freddie Mac Gold Pool ‘A35950’, 5.000 %, due 7/1/2035	222	0,02
41	Freddie Mac Gold Pool ‘A36526’, 5.000 %, due 8/1/2035	46	0,01
101	Freddie Mac Gold Pool ‘A39036’, 5.000 %, due 5/1/2035	112	0,01
13	Freddie Mac Gold Pool ‘A39302’, 5.500 %, due 11/1/2035	15	–
147	Freddie Mac Gold Pool ‘A81215’, 6.500 %, due 8/1/2038	163	0,02
3	Freddie Mac Gold Pool ‘A84166’, 6.500 %, due 1/1/2039	3	–
897	Freddie Mac Gold Pool ‘A92179’, 5.000 %, due 5/1/2040	989	0,11
731	Freddie Mac Gold Pool ‘A97953’, 5.000 %, due 4/1/2041	801	0,09
2	Freddie Mac Gold Pool ‘C00556’, 8.000 %, due 10/1/2027	2	–
1	Freddie Mac Gold Pool ‘C01025’, 8.000 %, due 7/1/2030	1	–
1	Freddie Mac Gold Pool ‘C01051’, 8.000 %, due 9/1/2030	1	–
4	Freddie Mac Gold Pool ‘C46047’, 8.000 %, due 12/1/2030	5	–
4	Freddie Mac Gold Pool ‘C55319’, 8.000 %, due 8/1/2031	4	–
–	Freddie Mac Gold Pool ‘C57324’, 8.000 %, due 9/1/2031	–	–
7	Freddie Mac Gold Pool ‘C91046’, 6.500 %, due 5/1/2027	7	–
3.519	Freddie Mac Gold Pool ‘C91764’, 3.500 %, due 5/1/2034	3.671	0,39
5.465	Freddie Mac Gold Pool ‘C91876’, 3.000 %, due 6/1/2036	5.630	0,60
4.731	Freddie Mac Gold Pool ‘C91981’, 3.000 %, due 2/1/2038	4.851	0,52
4.110	Freddie Mac Gold Pool ‘C91987’, 3.000 %, due 4/1/2038	4.218	0,45
2	Freddie Mac Gold Pool ‘G00556’, 8.000 %, due 9/1/2026	2	–
2	Freddie Mac Gold Pool ‘G00726’, 8.000 %, due 6/1/2027	2	–
1	Freddie Mac Gold Pool ‘G00931’, 8.000 %, due 11/1/2026	2	–
24	Freddie Mac Gold Pool ‘G01737’, 5.000 %, due 12/1/2034	27	–
11	Freddie Mac Gold Pool ‘G02427’, 5.500 %, due 12/1/2036	12	–
698	Freddie Mac Gold Pool ‘G02723’, 6.000 %, due 3/1/2037	801	0,09
14	Freddie Mac Gold Pool ‘G03092’, 5.500 %, due 7/1/2037	16	–
21	Freddie Mac Gold Pool ‘G03695’, 5.500 %, due 11/1/2037	24	–
59	Freddie Mac Gold Pool ‘G04581’, 6.500 %, due 8/1/2038	67	0,01
2	Freddie Mac Gold Pool ‘G04947’, 6.500 %, due 4/1/2038	3	–
10	Freddie Mac Gold Pool ‘G06669’, 6.500 %, due 9/1/2039	12	–
1.010	Freddie Mac Gold Pool ‘G06858’, 5.000 %, due 11/1/2041	1.110	0,12
235	Freddie Mac Gold Pool ‘G07335’, 7.000 %, due 3/1/2039	274	0,03
77	Freddie Mac Gold Pool ‘G07485’, 5.000 %, due 6/1/2041	85	0,01
491	Freddie Mac Gold Pool ‘G07509’, 6.500 %, due 9/1/2039	570	0,06
764	Freddie Mac Gold Pool ‘G07615’, 5.000 %, due 11/1/2041	841	0,09
3.599	Freddie Mac Gold Pool ‘G08700’, 4.500 %, due 3/1/2046	3.850	0,41
272	Freddie Mac Gold Pool ‘G08726’, 3.000 %, due 10/1/2046	280	0,03
470	Freddie Mac Gold Pool ‘G08822’, 3.000 %, due 7/1/2048	482	0,05
816	Freddie Mac Gold Pool ‘G08829’, 3.000 %, due 7/1/2048	836	0,09
583	Freddie Mac Gold Pool ‘G14492’, 4.000 %, due 10/1/2025	609	0,07
8.410	Freddie Mac Gold Pool ‘G16568’, 2.500 %, due 4/1/2033	8.532	0,91
456	Freddie Mac Gold Pool ‘G16672’, 3.000 %, due 3/1/2033	470	0,05
5.083	Freddie Mac Gold Pool ‘G18706’, 3.000 %, due 9/1/2033	5.214	0,55
40	Freddie Mac Gold Pool ‘G18715’, 3.000 %, due 12/1/2033	41	–
2.924	Freddie Mac Gold Pool ‘G60329’, 5.500 %, due 6/1/2040	3.298	0,35
9.409	Freddie Mac Gold Pool ‘G60344’, 4.000 %, due 12/1/2045	10.077	1,07
905	Freddie Mac Gold Pool ‘G61587’, 3.000 %, due 4/1/2047	930	0,10
13.651	Freddie Mac Gold Pool ‘G61814’, 3.500 %, due 9/1/2048	14.271	1,52
74	Freddie Mac Gold Pool ‘H00041’, 5.000 %, due 7/1/2035	75	0,01
5	Freddie Mac Gold Pool ‘H00790’, 5.500 %, due 5/1/2037	5	–
272	Freddie Mac Gold Pool ‘H02425’, 5.500 %, due 2/1/2038	300	0,03
4	Freddie Mac Gold Pool ‘H09170’, 5.500 %, due 1/1/2038	4	–
2.072	Freddie Mac Gold Pool ‘J38270’, 2.500 %, due 1/1/2033	2.102	0,22
1.411	Freddie Mac Gold Pool ‘J39537’, 3.000 %, due 9/1/2033	1.449	0,15
825	Freddie Mac Gold Pool ‘J39722’, 3.000 %, due 10/1/2033	846	0,09
955	Freddie Mac Gold Pool ‘J39962’, 3.000 %, due 12/1/2033	980	0,10
331	Freddie Mac Gold Pool ‘Q26702’, 4.000 %, due 6/1/2044	362	0,04
8.238	Freddie Mac Gold Pool ‘Q42046’, 3.500 %, due 7/1/2046	8.607	0,92
363	Freddie Mac Gold Pool ‘Q51352’, 3.500 %, due 10/1/2047	376	0,04
884	Freddie Mac Gold Pool ‘Q55429’, 4.000 %, due 4/1/2048	921	0,10
5.114	Freddie Mac Gold Pool ‘Q55997’, 4.000 %, due 5/1/2048	5.345	0,57
169	Freddie Mac Gold Pool ‘Q59125’, 5.000 %, due 10/1/2048	181	0,02
4.486	Freddie Mac Gold Pool ‘U69040’, 4.000 %, due 5/1/2045	4.768	0,51
866	Freddie Mac Gold Pool ‘U90245’, 3.500 %, due 10/1/2042	908	0,10
183	Freddie Mac Gold Pool ‘U90316’, 4.000 %, due 10/1/2042	195	0,02
1.023	Freddie Mac Gold Pool ‘U90378’, 4.000 %, due 11/1/2042	1.090	0,12
619	Freddie Mac Gold Pool ‘U90436’, 4.000 %, due 11/1/2042	660	0,07
1.901	Freddie Mac Gold Pool ‘U90503’, 3.500 %, due 11/1/2042	1.993	0,21
319	Freddie Mac Gold Pool ‘U90598’, 3.500 %, due 12/1/2042	335	0,04

^ *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^

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
124	Freddie Mac Gold Pool ‘U90608’, 3.500 %, due 12/1/2042	130	0,01
278	Freddie Mac Gold Pool ‘U90720’, 3.500 %, due 1/1/2043	290	0,03
207	Freddie Mac Gold Pool ‘U90768’, 3.500 %, due 1/1/2043	216	0,02
1.159	Freddie Mac Gold Pool ‘U90772’, 3.500 %, due 1/1/2043	1.215	0,13
257	Freddie Mac Gold Pool ‘U90778’, 3.500 %, due 1/1/2043	269	0,03
193	Freddie Mac Gold Pool ‘U90794’, 3.500 %, due 1/1/2043	202	0,02
5.167	Freddie Mac Gold Pool ‘U90809’, 3.500 %, due 2/1/2043	5.417	0,58
250	Freddie Mac Gold Pool ‘U90828’, 3.500 %, due 2/1/2043	262	0,03
332	Freddie Mac Gold Pool ‘U90841’, 3.500 %, due 2/1/2043	348	0,04
223	Freddie Mac Gold Pool ‘U90879’, 3.500 %, due 2/1/2043	234	0,03
309	Freddie Mac Gold Pool ‘U90903’, 3.500 %, due 2/1/2043	324	0,03
464	Freddie Mac Gold Pool ‘U90940’, 3.500 %, due 2/1/2043	486	0,05
248	Freddie Mac Gold Pool ‘U91027’, 3.500 %, due 2/1/2043	259	0,03
4.309	Freddie Mac Gold Pool ‘U99038’, 3.000 %, due 1/1/2043	4.450	0,47
1.969	Freddie Mac Gold Pool ‘U99045’, 3.500 %, due 3/1/2043	2.064	0,22
348	Freddie Mac Gold Pool ‘U99114’, 3.500 %, due 2/1/2044	364	0,04
10.828	Freddie Mac Gold Pool ‘U99124’, 3.500 %, due 3/1/2045	11.350	1,21
6.043	Freddie Mac Gold Pool ‘U99135’, 4.000 %, due 2/1/2044	6.441	0,69
7.769	Freddie Mac Gold Pool ‘V82781’, 3.000 %, due 12/1/2046	8.015	0,85
93.056	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K052, Class X1, 0,798 %, due 11/25/2025 *	3.255	0,35
59.644	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K065, Class X1, 0,814 %, due 4/25/2027 *	2.735	0,29
89.918	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K069, Class X1, 0,496 %, due 9/25/2027 *	2.493	0,27
99.578	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K070, Class X1, 0,457 %, due 11/25/2027 *	2.517	0,27
54.532	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K079, Class XAM, 0,222 %, due 6/25/2028 *	578	0,06
57.720	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K081, Class XAM, 0,209 %, due 8/25/2028 *	546	0,06
200	Freddie Mac Pool ‘QA1627’, 3.000 %, due 8/1/2049	204	0,02
200	Freddie Mac Pool ‘QA2090’, 3.000 %, due 8/1/2049	205	0,02
99	Freddie Mac Pool ‘RA1103’, 3.000 %, due 7/1/2049	102	0,01
2.500	Freddie Mac Pool ‘RA1293’, 3.000 %, due 9/1/2049	2.587	0,28
800	Freddie Mac Pool ‘RA1343’, 3.000 %, due 9/1/2049	822	0,09
5.600	Freddie Mac Pool ‘RA1352’, 3.000 %, due 9/1/2049	5.726	0,61
391	Freddie Mac Pool ‘ZA6498’, 3.500 %, due 3/1/2049	407	0,04
8.318	Freddie Mac Pool ‘ZM7235’, 4.000 %, due 7/1/2048	8.680	0,92
396	Freddie Mac Pool ‘ZN1436’, 5.000 %, due 11/1/2048	423	0,05
3.921	Freddie Mac Pool ‘ZN4119’, 3.000 %, due 3/1/2049	4.000	0,43
306	Freddie Mac Pool ‘ZS3059’, 5.500 %, due 12/1/2038	345	0,04
922	Freddie Mac Pool ‘ZS4725’, 3.000 %, due 7/1/2047	947	0,10
76	Freddie Mac Pool ‘ZS4727’, 4.000 %, due 7/1/2047	80	0,01
864	Freddie Mac Pool ‘ZS4738’, 3.000 %, due 10/1/2047	887	0,09
10.949	Freddie Mac Pool ‘ZS4758’, 3,000 %, due 3/1/2048	11.226	1,19
954	Freddie Mac Pool ‘ZS4788’, 3.000 %, due 9/1/2048	976	0,10
11.882	Freddie Mac Pool ‘ZS4790’, 4.000 %, due 9/1/2048	12.340	1,31
1.834	Freddie Mac Pool ‘ZT1596’, 5.000 %, due 1/1/2049	1.958	0,21
1.921	Freddie Mac Pool ‘ZT1863’, 3.500 %, due 4/1/2049	1.975	0,21
109	Freddie Mac REMICS 2750, Class SD, 4,955 %, due 6/15/2023 *	2	–
159	Freddie Mac REMICS 3684, Class JI, 2,042 %, due 11/15/2036 *	11	–
4.600	Freddie Mac REMICS 3810, Class WA, 6,527 %, due 6/15/2040 *	6.036	0,64
8.000	Freddie Mac REMICS 3998, Class DS, 4,305 %, due 2/15/2042 *	1.390	0,15
3.602	Freddie Mac REMICS 4280, Class AI, 3,000 %, due 2/15/2028	241	0,03
3.404	Freddie Mac REMICS 4808, Class SB, 4,005 %, due 7/15/2048 *	694	0,07
1.924	Freddie Mac REMICS 4813, Class CJ, 3,000 %, due 8/15/2048	1.929	0,21
3.718	Freddie Mac REMICS 4856, Class IO, 5,000 %, due 1/15/2049	593	0,06
6.082	Freddie Mac REMICS 4882, Class S, 3,855 %, due 5/15/2049 *	1.030	0,11
8.145	Freddie Mac REMICS 4915, Class SG, 3.856 %, due 9/25/2049 *∞	1.730	0,18
3.324	Freddie Mac Strips 312, Klasse S1, 3,755 %, due 9/15/2043 *	573	0,06
1.100	Freddie Mac, 30 year, TBA, 3.000 % ∞±	1.128	0,12
1	Ginnie Mae I Pool ‘410304’, 7,500 %, due 12/15/2025	1	–
1	Ginnie Mae I Pool ‘417463’, 7,000 %, due 9/15/2025	1	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘430208’, 7,000 %, due 9/15/2027	–	–
1	Ginnie Mae I Pool ‘462669’, 7,000 %, due 4/15/2028	1	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘486470’, 6,500 %, due 8/15/2028	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘486516’, 6,500 %, due 9/15/2028	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘519569’, 8,000 %, due 5/15/2030	–	–
81	Ginnie Mae I Pool ‘646044’, 6,500 %, due 10/15/2037	89	0,01
2	Ginnie Mae I Pool ‘652203’, 5,000 %, due 3/15/2036	2	–
6	Ginnie Mae I Pool ‘658182’, 6,000 %, due 11/15/2036	6	–
2	Ginnie Mae I Pool ‘675375’, 5,000 %, due 5/15/2038	3	–
3	Ginnie Mae I Pool ‘676940’, 5,000 %, due 4/15/2038	4	–
10	Ginnie Mae I Pool ‘683926’, 5,000 %, due 2/15/2038	11	–
7	Ginnie Mae I Pool ‘684334’, 5,000 %, due 2/15/2038	7	–
6	Ginnie Mae I Pool ‘684754’, 5,000 %, due 4/15/2038	7	–
4	Ginnie Mae I Pool ‘684848’, 5,000 %, due 4/15/2038	4	–
3	Ginnie Mae I Pool ‘686062’, 5,000 %, due 5/15/2038	3	–
72	Ginnie Mae I Pool ‘698086’, 6,000 %, due 4/15/2039	80	0,01
28	Ginnie Mae I Pool ‘701501’, 5,000 %, due 12/15/2038	31	–
621	Ginnie Mae I Pool ‘701947’, 5,000 %, due 6/15/2039	695	0,07
321	Ginnie Mae I Pool ‘733600’, 5,000 %, due 4/15/2040	346	0,04
662	Ginnie Mae I Pool ‘733627’, 5,000 %, due 5/15/2040	742	0,08
–	Ginnie Mae I Pool ‘780059’, 11,000 %, due 4/15/2021	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘780066’, 10,500 %, due 12/15/2020	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘780081’, 10,000 %, due 2/15/2025	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘780082’, 10,500 %, due 2/15/2025	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘780141’, 10,000 %, due 12/15/2020	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘780488’, 10,000 %, due 10/15/2021	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘780574’, 10,000 %, due 12/15/2021	–	–
3	Ginnie Mae I Pool ‘780732’, 7,000 %, due 3/15/2028	3	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘780835’, 10,000 %, due 7/15/2022	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘780991’, 9,000 %, due 11/15/2024	–	–
2	Ginnie Mae I Pool ‘781001’, 7,500 %, due 3/15/2029	2	–
109	Ginnie Mae I Pool ‘781590’, 5,500 %, due 4/15/2033	123	0,01
724	Ginnie Mae I Pool ‘781994’, 5,500 %, due 11/15/2033	823	0,09
7	Ginnie Mae I Pool ‘782198’, 6,000 %, due 10/15/2037	8	–
783	Ginnie Mae I Pool ‘784571’, 3,500 %, due 6/15/2048	825	0,09
295	Ginnie Mae I Pool ‘AA5649’, 3,000 %, due 9/15/2042	306	0,03
434	Ginnie Mae I Pool ‘AB2892’, 3,000 %, due 9/15/2042	450	0,05
114	Ginnie Mae I Pool ‘AB9108’, 3,000 %, due 10/15/2042	118	0,01
625	Ginnie Mae I Pool ‘AB9109’, 3,000 %, due 10/15/2042	647	0,07
1.045	Ginnie Mae I Pool ‘AB9205’, 3,000 %, due 11/15/2042	1.081	0,12
548	Ginnie Mae I Pool ‘AB9207’, 3,000 %, due 11/15/2042	568	0,06
14	Ginnie Mae II Pool ‘4040’, 6,500 %, due 10/20/2037	17	–
22	Ginnie Mae II Pool ‘4170’, 6,000 %, due 6/20/2038	25	–
1.580	Ginnie Mae II Pool ‘4245’, 6,000 %, due 9/20/2038	1.809	0,19
247	Ginnie Mae II Pool ‘4602’, 6,000 %, due 12/20/2039	279	0,03
311	Ginnie Mae II Pool ‘4617’, 4,500 %, due 1/20/2040	336	0,04
162	Ginnie Mae II Pool ‘4696’, 4,500 %, due 5/20/2040	175	0,02
95	Ginnie Mae II Pool ‘4747’, 5,000 %, due 7/20/2040	105	0,01
102	Ginnie Mae II Pool ‘4772’, 5,000 %, due 8/20/2040	112	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^

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
7	Ginnie Mae II Pool ‘4774’, 6,000 %, due 8/20/2040	8	–
209	Ginnie Mae II Pool ‘4802’, 5,000 %, due 9/20/2040	231	0,02
76	Ginnie Mae II Pool ‘4855’, 5,000 %, due 11/20/2040	84	0,01
34	Ginnie Mae II Pool ‘4923’, 4,500 %, due 1/20/2041	36	–
23	Ginnie Mae II Pool ‘4928’, 6,000 %, due 1/20/2041	26	–
1.212	Ginnie Mae II Pool ‘4978’, 4,500 %, due 3/20/2041	1.312	0,14
2.699	Ginnie Mae II Pool ‘783050’, 5,000 %, due 7/20/2040	2.978	0,32
2.062	Ginnie Mae II Pool ‘783298’, 4,500 %, due 4/20/2041	2.231	0,24
5.919	Ginnie Mae II Pool ‘784577’, 4,000 %, due 7/20/2047	6.237	0,66
5.287	Ginnie Mae II Pool ‘892346’, 5,092 %, due 8/20/2059 *	5.558	0,59
283	Ginnie Mae II Pool ‘892614’, 4,493 %, due 8/20/2060 *	302	0,03
1.815	Ginnie Mae II Pool ‘AV0243’, 3,500 %, due 8/20/2046	1.931	0,21
3.282	Ginnie Mae II Pool ‘AV8310’, 3,500 %, due 8/20/2046	3.471	0,37
3.286	Ginnie Mae II Pool ‘AV8311’, 3,500 %, due 8/20/2046	3.464	0,37
3.322	Ginnie Mae II Pool ‘AV8312’, 3,500 %, due 8/20/2046	3.499	0,37
3.397	Ginnie Mae II Pool ‘AZ3074’, 4,000 %, due 2/20/2047	3.575	0,38
9.526	Ginnie Mae II Pool ‘BC4732’, 3,500 %, due 10/20/2047	9.947	1,06
1.555	Ginnie Mae II Pool ‘BC5293’, 3,500 %, due 8/20/2047	1.638	0,17
9.818	Ginnie Mae II Pool ‘BC5429’, 3,500 %, due 10/20/2047	10.297	1,09
1.717	Ginnie Mae II Pool ‘BC7516’, 3,500 %, due 10/20/2047	1.808	0,19
7.446	Ginnie Mae II Pool ‘BD0384’, 3,500 %, due 10/20/2047	7.816	0,83
1.440	Ginnie Mae II Pool ‘BD3554’, 3,500 %, due 10/20/2047	1.517	0,16
3.395	Ginnie Mae II Pool ‘BD3555’, 3,500 %, due 10/20/2047	3.575	0,38
1.568	Ginnie Mae II Pool ‘BD3636’, 3,500 %, due 10/20/2047	1.652	0,18
4.858	Ginnie Mae II Pool ‘BD4734’, 3,500 %, due 10/20/2047	5.118	0,54
7.375	Ginnie Mae II Pool ‘BD6814’, 3,500 %, due 10/20/2047	7.767	0,83
5.630	Ginnie Mae II Pool ‘BF7008’, 4,500 %, due 7/20/2048	5.833	0,62
8.338	Ginnie Mae II Pool ‘BF7597’, 4,000 %, due 7/20/2048	8.717	0,93
10.301	Ginnie Mae II Pool ‘BF7680’, 4,500 %, due 7/20/2048	10.668	1,13
10.431	Ginnie Mae II Pool ‘BH1521’, 4,500 %, due 7/20/2048	10.823	1,15
1.094	Ginnie Mae II Pool ‘BH1846’, 4,500 %, due 7/20/2048	1.134	0,12
3.332	Ginnie Mae II Pool ‘BH1870’, 4,500 %, due 8/20/2048	3.567	0,38
77	Ginnie Mae II Pool ‘BJ1835’, 4,500 %, due 9/20/2048	80	0,01
157	Ginnie Mae II Pool ‘BJ1853’, 4,500 %, due 9/20/2048	162	0,02
350	Ginnie Mae II Pool ‘MA1995’, 3,500 %, due 6/20/2044	369	0,04
38	Ginnie Mae II Pool ‘MA2678’, 3,500 %, due 3/20/2045	39	–
191	Ginnie Mae II Pool ‘MA3937’, 3,500 %, due 9/20/2046	200	0,02
21.416	Ginnie Mae II Pool ‘MA4003’, 3,000 %, due 10/20/2046	22.188	2,36
862	Ginnie Mae II Pool ‘MA4511’, 4,000 %, due 6/20/2047	905	0,10
731	Ginnie Mae II Pool ‘MA4781’, 5,000 %, due 10/20/2047	783	0,08
1.771	Ginnie Mae II Pool ‘MA4837’, 3,500 %, due 11/20/2047	1.849	0,20
989	Ginnie Mae II Pool ‘MA4838’, 4,000 %, due 11/20/2047	1.036	0,11
928	Ginnie Mae II Pool ‘MA4901’, 4,000 %, due 12/20/2047	973	0,10
692	Ginnie Mae II Pool ‘MA5019’, 3,500 %, due 2/20/2048	721	0,08
318	Ginnie Mae II Pool ‘MA5020’, 4,000 %, due 2/20/2048	332	0,04
559	Ginnie Mae II Pool ‘MA5078’, 4,000 %, due 3/20/2048	584	0,06
323	Ginnie Mae II Pool ‘MA5137’, 4,000 %, due 4/20/2048	337	0,04
140	Ginnie Mae II Pool ‘MA5265’, 4,500 %, due 6/20/2048	147	0,02
666	Ginnie Mae II Pool ‘MA5330’, 4,000 %, due 7/20/2048	696	0,07
1.058	Ginnie Mae II Pool ‘MA5331’, 4,500 %, due 7/20/2048	1.111	0,12
313	Ginnie Mae II Pool ‘MA5467’, 4,500 %, due 9/20/2048	328	0,04
3.893	Ginnie Mae II Pool ‘MA5712’, 5,000 %, due 1/20/2049	4.095	0,44
386	Ginnie Mae II Pool ‘MA5762’, 3,500 %, due 2/20/2049	401	0,04
1.267	Ginnie Mae II Pool ‘MA5818’, 4,500 %, due 3/20/2049	1.328	0,14
794	Ginnie Mae II Pool ‘MA5931’, 4,000 %, due 5/20/2049	830	0,09
1.500	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3.000 % ±	1.545	0,16
3.000	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3.000 % ±	3.093	0,33
8.600	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 % ±	8.937	0,95
600	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4.000 % ±	625	0,07
500	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4.500 % ±	523	0,06
1.443	Government National Mortgage Association, Series 2004 81, Class SK, 4,003 %, due 10/16/2034 *	190	0,02
2.678	Government National Mortgage Association, Series 2008 40, Class SC, 4,153 %, due 5/16/2038 *	511	0,05
3.430	Government National Mortgage Association, Series 2008 79, Class ID, 4,628 %, due 6/20/2035 *	754	0,08
990	Government National Mortgage Association, Series 2010 H02, Class FA, 2,921 %, due 2/20/2060 *	995	0,11
1.437	Government National Mortgage Association, Series 2010 H20, Class AF, 2,710 %, due 10/20/2060 *	1.432	0,15
4.418	Government National Mortgage Association, Series 2010 H22, Class FE, 2,730 %, due 5/20/2059 *	4.413	0,47
841	Government National Mortgage Association, Series 2010 H28, Class FE, 2,780 %, due 12/20/2060 *	840	0,09
82	Government National Mortgage Association, Series 2011 2, Class NS, 3,883 %, due 3/16/2039 *	–	–
5.445	Government National Mortgage Association, Series 2012 H21, Class FA, 2,880 %, due 7/20/2062 *	5.450	0,58
22.775	Government National Mortgage Association, Series 2013 93, Class SA, 4,003 %, due 6/16/2043 *	4.374	0,47
7.283	Government National Mortgage Association, Series 2014 117, Class SJ, 3,428 %, due 8/20/2044 *	1.233	0,13
1.984	Government National Mortgage Association, Series 2014 2, Class CI, 4,500 %, due 1/20/2044	409	0,04
5.545	Government National Mortgage Association, Series 2014 60, Class SA, 3,903 %, due 4/16/2044 *	1.047	0,11
16.667	Government National Mortgage Association, Series 2015 136, Class IO, 0,655 %, due 8/16/2055 *	743	0,08
9.799	Government National Mortgage Association, Series 2015 177, Class MI, 5,000 %, due 10/20/2044	1.895	0,20
81.969	Government National Mortgage Association, Series 2017 111, Class IO, 0,740 %, due 2/16/2059 *	5.463	0,58
4.181	Government National Mortgage Association, Series 2017 19, Class SE, 3,953 %, due 2/16/2047 *	841	0,09
10.018	Government National Mortgage Association, Series 2017 26, Class IQ, 5,000 %, due 2/20/2040	1.914	0,20
346	Government National Mortgage Association, Series 2017 H13, Class FJ, 2,580 %, due 5/20/2067 *	345	0,04
6.868	Government National Mortgage Association, Series 2018 125, Class HS, 4,078 %, due 9/20/2048 *	966	0,10
12.942	Government National Mortgage Association, Series 2018 134, Class SM, 4,028 %, due 10/20/2048 *	1.754	0,19
2.223	Government National Mortgage Association, Series 2018 37, Class QA, 2,750 %, due 3/20/2048	2.266	0,24
2.232	Government National Mortgage Association, Series 2019 28, Class AB, 3,150 %, due 6/16/2060 *	2.285	0,24
3.740	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Class A, 144A, 3,495 %, due 9/15/2031 *	3.700	0,39
3.880	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Class B, 144A, 4,695 %, due 9/15/2031 *	3.839	0,41
2.120	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS8, Series 2017 GS8, Klasse A4, 3.469 %, due 11/10/2050	2.320	0,25
63.735	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Klasse AX1, 144A, 0,338 %, due 10/25/2048 *†	799	0,09
2.553	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Series 2018 3A, Class A1, 144A, 4,500 %, due 5/25/2058 *	2.704	0,29
	Hypothekarisch besicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 915.701)	934.946	99,39
	Investmentfonds - 6,36 % (28. Februar 2019: 4,08 %)		
59.826	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (ausschüttend)	59.826	6,36
	Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 59.826)	59.826	6,36
	Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 986.009)	1.005.365	106,88
	Futures – 0,03 % (28. Februar 2019: 0,01 %)		
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	258	0,03
	Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.005.623	106,91
	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)		
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(22)	–

^ *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^

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Futures – (0,05 %) (28. Februar 2019: (0,02 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(479)	(0,05)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert finanzielle Verbindlichkeiten		(501)	(0,05)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete bewertete finanzielle Vermögenswerte		1.005.122	106,86
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(64.458)	(6,86)
Nettovermögen insgesamt	USD	940.664	100,00

– Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Registrierung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 31. August 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 20.784.000 oder 2,21 % des Nettovermögens.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

† Illiquide.

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

± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.

ABKÜRZUNGEN:

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

TBA – To Be Announced (wird angekündigt)

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,29
Investmentfonds	5,84
Derivate	0,03
Sonstige Vermögenswerte	1,84
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
09.12.2019	BNY Mellon	Kauf	EUR	962	Verkauf	USD	1.080	USD	(22)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD–)									–
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD–)									(22)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD–)								USD	(22)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) December 2019	(704)	USD (92.730)	USD (380)
U.S. 10 Year Ultra Note December 2019	(201)	(29.032)	(99)
U.S. 2 Year Note (CBT) December 2019	8	1.729	2
U.S. 5 Year Note (CBT) December 2019	205	24.595	40
U.S. Long Bond (CBT) December 2019	15	2.479	20
U.S. Ultra Bond (CBT) December 2019	88	17.374	196
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 100)			258
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (207))			(479)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (107))			USD (221)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 87,65 % 28. Februar 2019 85,44 %)			
Australien – 0,09 % (28. Februar 2019: 0,47 %)			
90	Westpac Banking Corp, 4,421 %, due 7/24/2039	101	0,09
Belgien – 2,25 % (28. Februar 2019: 3,13 %)			
130	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650 %, due 2/1/2026	140	0,12
280	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, due 1/12/2024	297	0,27
520	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,150 %, due 1/23/2025	570	0,51
640	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,750 %, due 1/23/2029	748	0,67
460	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, due 4/15/2048	535	0,48
170	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, due 1/23/2049	223	0,20
		2.513	2,25
Brasilien – 0,92 % (28. Februar 2019: 0,92 %)			
166	Petrobras Global Finance BV, 5,375 %, due 1/27/2021	172	0,15
260	Petrobras Global Finance BV, 6,900 %, due 3/19/2049	296	0,26
200	Suzano Austria GmbH, 5,000 %, due 1/15/2030	206	0,19
53	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, due 11/21/2036	67	0,06
270	Argonaut Gold Inc 4,625 %, due 12/15/2027	287	0,26
		1.028	0,92
Kanada – 0,53 % (28. Februar 2019: 0,30 %)			
130	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, due 5/30/2041	169	0,15
70	Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, due 10/15/2039	93	0,08
250	Bell Canada Inc., 4,300 %, due 7/29/2049	295	0,27
30	Hudbay Minerals Inc, 144A, 7,250 %, due 1/15/2023	31	0,03
		588	0,53
Kaimaninseln – 0,33 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
370	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, due 9/15/2024	369	0,33
Kolumbien – 0,29 % (28. Februar 2019: 0,28 %)			
190	Ecopetrol SA, 5,375 %, due 6/26/2026	213	0,19
90	Ecopetrol SA, 5,875 %, due 5/28/2045	106	0,10
		319	0,29
Denmark – 1,60 % (28. Februar 2019: 0,63 %)			
1.470	Danske Bank A/S, 144A, 5,000 %, due 1/12/2022	1.551	1,38
220	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, due 1/12/2024	243	0,22
		1.794	1,60
Frankreich – 0,63 % (28. Februar 2019: 2,13 %)			
270	BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, due 1/10/2025 *	293	0,26
230	BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, due 1/10/2030 *	271	0,24
120	WEA Finance LLC, 144A, 4,625 %, due 9/20/2048	144	0,13
		708	0,63
Irland – 1,05 % (28. Februar 2019: 0,73 %)			
270	AerCap Ireland Capital DAC/ AerCap Global Aviation Trust, 4,875 %, due 1/16/2024	293	0,26
220	Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 3,625 %, due 5/1/2022	223	0,20
70	Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 5,125 %, due 10/1/2023	75	0,07
150	Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 3,950 %, due 7/1/2024	155	0,14
110	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,250 %, due 8/15/2022	116	0,10
290	SMBC Aviation Capital Finance DAC, 144A, 4,125 %, due 7/15/2023	308	0,28
		1.170	1,05
Israel – 1,51 % (28. Februar 2019: 1,17 %)			
40	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, due 12/18/2022	35	0,03
1.660	Teva Pharmaceutical Finance Niederlande III BV, 2,200 %, due 7/21/2021	1.560	1,40
110	Teva Pharmaceutical Finance Niederlande III BV, 2,800 %, due 7/21/2023	93	0,08
		1.688	1,51
Italien – 4,53 % (28. Februar 2019: 2,00 %)			
710	Intesa Sanpaolo SPA, Serie 0000, 144A, 6,500 %, due 2/24/2021	746	0,67
730	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,125 %, due 7/14/2022	733	0,66
200	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,375 %, due 1/12/2023	203	0,18
310	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, due 1/15/2026	327	0,29
80	Telecom Italia Capital SA, 7,200 %, due 7/18/2036	90	0,08
60	Telecom Italia Capital SA, 7,721 %, due 6/4/2038	70	0,06
220	Telecom Italia SpA/Milano,144A, 5,303 %, due 5/30/2024	236	0,21
1.290	UniCredit SpA, 144A, 6,572 %, due 1/14/2022	1.387	1,24
910	UniCredit SPA, 144A, 7,296 %, fällig am 2. April 2034 *	1.029	0,92
EUR 200	UniCredit SpA, 7,500 %, Perpetual	242	0,22
		5.063	4,53
Kasachstan – 0,33 % (28. Februar 2019: 0,28 %)			
320	KazMunayGas National Co JSC, 144A, 5,375 %, due 4/24/2030	372	0,33
Kuwait – 0,35 % (28. Februar 2019: 0,59 %)			
390	NBK SPC LTD, 144A, 2,750 %, due 5/30/2022	393	0,35
Luxemburg – 0,83 % (28. Februar 2019: 0,29 %)			
230	ArcelorMittal 6,125 %, due 6/1/2025	259	0,23
520	ArcelorMittal 4,550 %, due 3/11/2026	545	0,49
50	ArcelorMittal 7,000 %, due 10/15/2039	60	0,06
50	ArcelorMittal 6,750 %, due 3/1/2041	59	0,05
		923	0,83
Sambia – 0,97 % (28. February 2019: 0,51 %)			
200	Sands China Ltd 4,600 %, due 8/8/2023	213	0,19
580	Sands China Ltd 5,125 %, due 8/8/2025	644	0,57
200	Sands China Ltd 5,400 %, due 8/8/2028	231	0,21
		1.088	0,97
Mexiko – 0,28 % (28. Februar 2019: 0,80 %)			
150	Petroleos Mexicanos, 6,875 %, due 8/4/2026	158	0,14
160	Petroleos Mexicanos, 6,625 %, due 6/15/2035	156	0,14
		314	0,28
Niederlande – 1,36 % (28. Februar 2019: 1,81 %)			
1.080	Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, due 12/1/2023	1.168	1,04
290	Shell International Finance BV, 4,375 %, due 5/11/2045	356	0,32
		1.524	1,36
Peru – 0,08 % (28. Februar 2019: 0,13 %)			
80	Southern Copper Corp, 5,250 %, due 11/8/2042	93	0,08
Russland – 0,27 % (28. Februar 2019: 0,24 %)			
280	Lukoil International Finance BV, 144A, 4,750 %, due 11/2/2026	305	0,27
Südafrika – 0,33 % (28. Februar 2019: 0,48 %)			
360	Anglo American Capital Plc, 144A, 3,750 %, due 4/10/2022	370	0,33
Spanien – 0,19 % (28. Februar 2019: 0,72 %)			
200	Banco Santander SA 3,306 %, due 6/27/2029	210	0,19
Schweiz – 2,99 % (28. Februar 2019: 3,39 %)			
610	Credit Suisse AG/New York NY, 5,400 %, due 1/14/2020	617	0,55
220	Credit Suisse Group AG 6,375 %, Perpetual *	228	0,20
70	Credit Suisse USA Inc, 7,125 %, due 7/15/2032	104	0,09
660	Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 4,250 %, due 10/25/2022	693	0,62
30	Glencore Funding LLC, 144A, 3,000 %, due 10/27/2022	30	0,03
350	Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, due 3/12/2024	369	0,33
460	Glencore Funding LLC, 144A, 4,625 %, due 4/29/2024	488	0,44
100	Glencore Funding LLC, 144A, 3,875 %, due 10/27/2027	103	0,09
200	UBS Group AG, 144A, 3,126 %, due 8/13/2030 *	205	0,18
480	UBS Group Funding Switzerland AG, 144A, 7,000 %, due 3/23/2028	509	0,46
		3.346	2,99
Vereinigte Arabische Emirate - 0,45 % 28. Februar 2019 0,40 %)			
250	Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 144A, 4,375 %, due 4/23/2025	271	0,24
200	Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 144A, 4,875 %, due 4/23/2030	232	0,21
		503	0,45
Großbritannien – 6,53 % (28. Februar 2019: 5,91 %)			
100	Barclays Bank Plc, 144A, 10,179 %, due 6/12/2021	112	0,10
510	OTP Bank Plc 7,625 %, due 11/21/2022	563	0,50
680	Barclays Plc 5,088 %, due 6/20/2030 *	707	0,63
50	British Telecommunications Plc, 9,625 %, due 12/15/2030	77	0,07
200	HSBC Holdings Plc 4,583 %, due 6/19/2029 *	224	0,20
440	HSBC Holdings Plc 3,973 %, due 5/22/2030 *	473	0,42
230	HSBC Holdings Plc 6,000 %, Perpetual *	231	0,21
250	HSBC Holdings Plc 6,500 %, Perpetual *	257	0,23
460	Lloyds Banking Group Plc, 3,000 %, due 1/11/2022	466	0,42

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Großbritannien – (Fortsetzung)			
200	Lloyds Banking Group Plc, 3,900 %, due 3/12/2024	210	0,19
400	Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, due 3/22/2028	436	0,39
240	Lloyds Banking Group Plc, 3,574 %, due 11/7/2028 *	246	0,22
165	Reynolds American Inc, 8,125 %, fällig am 1. 5/2040	228	0,20
230	Royal Bank of Scotland Group Plc, 4,269 %, due 3/22/2025 *	240	0,22
500	Royal Bank of Scotland Group Plc, 5,076 %, due 1/27/2030 *	561	0,50
950	Royal Bank of Scotland Group Plc, 8,625 %, Perpetual *	1.008	0,90
930	Santander UK Plc, 144 A, 5,000 %, fällig am 7. November 2023	985	0,88
30	Pennon Group PLC 4,375 %, due 5/30/2028	34	0,03
80	Pennon Group PLC 6,150 %, due 2/27/2037	102	0,09
120	Pennon Group PLC 5,250 %, due 5/30/2048	144	0,13
		7.304	6,53
USA – 58,47 % (28. Februar 2019: 55,70 %)			
160	Abbott Laboratories, 4,750 %, due 11/30/2036	201	0,18
30	Abbott Laboratories, 4,900 %, due 11/30/2046	40	0,04
200	Aetna Inc 2,800 %, due 6/15/2023	203	0,18
200	Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, due 5/15/2028	208	0,19
100	Allergan Funding SCS, 3,450 %, due 3/15/2022	103	0,09
40	Allergan Funding SCS, 3,800 %, due 3/15/2025	42	0,04
20	Allergan Funding SCS, 4,550 %, due 3/15/2035	22	0,02
70	Altria Group Inc 2,850 %, due 8/9/2022	71	0,06
90	Altria Group Inc 3,800 %, due 2/14/2024	95	0,09
380	Altria Group Inc 4,400 %, due 2/14/2026	417	0,37
710	Altria Group Inc 4,800 %, due 2/14/2029	803	0,72
210	Amazon.com Inc 3,150 %, due 8/22/2027	226	0,20
120	Amazon.com Inc 3,875 %, due 8/22/2037	140	0,13
146	American Airlines 2014-1 Class B Pass Through Trust, 4,375 %, fällig 10/1/2022	149	0,13
89	American Airlines 2015-1 Class B Pass Through Trust, 3,700 %, fällig am 1. 5/2023	91	0,08
620	American Express Co, 2,500 %, due 7/30/2024	632	0,57
90	American International Group Inc 4,750 %, due 4/1/2048	107	0,10
50	Amgen Inc 3,625 %, due 5/22/2024	53	0,05
80	Amgen Inc 4,400 %, due 5/1/2045	91	0,08
70	Amgen Inc 4,663 %, due 6/15/2051	83	0,07
330	Anadarko Petroleum Corp, 4,850 %, due 3/15/2021	341	0,31
600	Anadarko Petroleum Corp, 6,450 %, due 9/15/2036	756	0,68
60	Anadarko Petroleum Corp, 7,950 %, due 6/15/2039	84	0,07
150	Hymne Inc, 3,650 %, due 12/1/2027	159	0,14
130	Hymne Inc, 4,375 %, due 12/1/2047	146	0,13
400	Apache Corp 4,750 %, due 4/15/2043	387	0,35
150	Apache Corp 5,350 %, due 7/1/2049	157	0,14
140	AT&T Inc 4,450 %, due 4/1/2024	152	0,14
220	AT&T Inc 3,800 %, due 2/15/2027	235	0,21
270	AT&T Inc 4,300 %, due 2/15/2030	300	0,27
280	AT&T Inc 4,500 %, due 5/15/2035	312	0,28
10	AT&T Inc 6,350 %, due 3/15/2040	13	0,01
130	AT&T Inc 5,550 %, due 8/15/2041	157	0,14
180	Bank of America Corp, 4,200 %, due 8/26/2024	194	0,17
220	Bank of America Corp, 3,705 %, due 4/24/2028 *	237	0,21
170	Bank of America Corp, 3,593 %, due 7/21/2028 *	182	0,16
232	Bank of America Corp, 3,419 %, due 12/20/2028 *	246	0,22
250	Bank of America Corp, 4,271 %, due 7/23/2029 *	282	0,25
70	Bank of America Corp, 3,974 %, due 2/7/2030 *	78	0,07
20	Bank of America Corp, 4,443 %, due 1/20/2048 *	25	0,02
170	Bank of America Corp, 4,330 %, due 3/15/2050 *	208	0,19
245	Becton Dickinson and Co, 3,194 %, due 12/29/2020 *	245	0,22
120	Becton Dickinson und Co, 3,700 %, fällig 6/6/2027	129	0,11
85	Becton Dickinson and Co, 4,685 %, due 12/15/2044	101	0,09
1.060	Boeing Co/The, 3,100 %, due 5/1/2026	1.121	1,00
110	Boeing Co/The, 3,300 %, due 3/1/2035	112	0,10
220	Boeing Co/The, 3,750 %, due 2/1/2050	245	0,22
390	Boeing Co/The, 3,950 %, due 8/1/2059	442	0,40
220	BP Capital Markets America Inc, 3,410 %, due 2/11/2026	235	0,21
160	BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, due 5/4/2026	168	0,15
680	Bristol-Myers Squibb Co 3,400 %, due 7/26/2029	737	0,66
120	Bristol-Myers Squibb Co 4,250 %, due 10/26/2049	144	0,13
130	Burlington Northern Santa Fe LLC, 4,400 %, due 3/15/2042	155	0,14
110	Carlyle Finance LLC, 144A, 5,650 %, due 9/15/2048	134	0,12
80	Carlyle Holdings II Finance LLC, 144A, 5,625 %, due 3/30/2043	96	0,09
130	Celgene Corp 3,550 %, due 8/15/2022	135	0,12
250	Celgene Corp 3,875 %, due 8/15/2025	271	0,24
240	Centerpoint Energy Houston Electric LLC, Serie AA, 3,000 %, fällig am 2/1/2027	253	0,23
90	Charles Schwab Corp/The, 3,850 %, due 5/21/2025	98	0,09
240	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 144A 3,750 %, due 2/15/2028	248	0,22
50	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 144A 4,200 %, due 3/15/2028	53	0,05
20	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 144A 5,375 %, due 4/1/2038	23	0,02
50	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 144A 5,375 %, due 5/1/2047	56	0,05
130	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 144A 5,750 %, due 4/1/2048	152	0,14
60	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 144A 5,125 %, due 7/1/2049	66	0,06
220	Cigna Corp, 4,125 %, due 11/15/2025	239	0,21
260	Cigna Corp, 4,375 %, due 10/15/2028	291	0,26
250	Cigna Corp, 4,800 %, due 8/15/2038	289	0,26
350	Cimarex Energy Co, 4,375 %, due 6/1/2024	369	0,33
260	Cimarex Energy Co, 3,900 %, due 5/15/2027	266	0,24
70	Cintas Corp Nr. 2, 3,700 %, due 4/1/2027	77	0,07
130	Citigroup Inc 3,980 %, due 3/20/2030 *	144	0,13
660	Citigroup Inc 8,125 %, due 7/15/2039	1.104	0,99
350	Citigroup Inc 4,650 %, due 7/23/2048	441	0,39
400	Cleveland Electric Illuminating Co/The, 144A, 3,500 %, Due 4/1/2028	424	0,38
100	CME Group Inc 3,750 %, due 6/15/2028	113	0,10
220	Comcast Corp 3,150 %, due 2/15/2028	232	0,21
290	Comcast Corp 4,250 %, due 10/15/2030	337	0,30
290	Comcast Corp 6,500 %, due 11/15/2035	411	0,37
140	Comcast Corp 4,600 %, due 10/15/2038	170	0,15
50	Comcast Corp 3,969 %, due 11/1/2047	56	0,05
110	Comcast Corp 4,700 %, due 10/15/2048	138	0,12
140	Comcast Corp 4,950 %, due 10/15/2058	183	0,16
240	Commonwealth Edison Co, 6,450 %, due 1/15/2038	354	0,32
30	Commonwealth Edison Co, 4,000 %, fällig am 1.3.2048	35	0,03
420	Concho Resources Inc, 4,375 %, due 1/15/2025	436	0,39
50	Concho Resources Inc, 3,750 %, due 10/1/2027	52	0,05
40	Constellation Brands Inc, 3,700 %, due 12/6/2026	43	0,04
30	Constellation Brands Inc, 3,500 %, due 5/9/2027	32	0,03
40	Continental Airlines 2007 - 1 Class A Pass Through Trust, Serie 071A, 5,983 %, due 4/19/2022	42	0,04
370	Continental Resources Inc/ OK, 5,000 %, due 9/15/2022	374	0,33
90	Continental Resources Inc/ OK, 4,500 %, due 4/15/2023	93	0,08
140	Continental Resources Inc/ OK, 3,800 %, due 6/1/2024	142	0,13
60	Continental Resources Inc/ OK, 4,375 %, due 1/15/2028	62	0,06
150	CRC Health Corp 4,000 %, due 12/5/2023	160	0,14
220	CRC Health Corp 2,625 %, due 8/15/2024	222	0,20
220	CRC Health Corp 4,100 %, due 3/25/2025	236	0,21
40	CRC Health Corp 3,000 %, due 8/15/2026	41	0,04
800	CRC Health Corp 4,300 %, due 3/25/2028	873	0,78

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
70	CRC Health Corp 3,250 %, due 8/15/2029	71	0,06
10	CRC Health Corp 4,780 %, due 3/25/2038	11	0,01
110	CRC Health Corp 5,125 %, due 7/20/2045	128	0,11
180	CRC Health Corp 5,050 %, due 3/25/2048	210	0,19
350	Delphi Financial Group Inc, 7,875 %, due 1/31/2020	358	0,32
30	Devon Energy Corp 7,950 %, due 4/15/2032	44	0,04
90	Devon Energy Corp 5,600 %, due 7/15/2041	111	0,10
270	Devon Energy Corp 5,000 %, due 6/15/2045	318	0,28
90	DISCOVERY COMMUNICATIONS INC 4,125 %, due 5/15/2029	96	0,09
40	DISCOVERY COMMUNICATIONS INC 5,300 %, due 5/15/2049	46	0,04
360	Dollarbaum Inc, 3,700 %, due 5/15/2023	375	0,34
280	Dollarbaum Inc, 4,200 %, due 5/15/2028	299	0,27
160	Dominion Energy Inc, 2,579 %, due 7/1/2020	160	0,14
220	Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, due 2/15/2040	291	0,26
60	Duke Energy Corp 3,150 %, due 8/15/2027	63	0,06
110	Eaton Corp., 4,150 %, due 11/2/2042	125	0,11
200	Energieübertragung Betrieb LP, Serie 5Y, 4,200 %, due 9/15/2023	212	0,19
10	Energy Transfer Operating LP, 6,625 %, due 10/15/2036	12	0,01
10	Energieübertragung Betrieb LP, Serie 20Y, 5,800 %, due 6/15/2038	12	0,01
110	Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, due 10/16/2028	122	0,11
190	Enterprise Products Operating LLC, 4,250 %, due 2/15/2048	207	0,18
350	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, due 2/15/2078 *	342	0,31
190	Continental Resources Inc, 4,150 % due 1/15/2026	212	0,19
60	Exxon Mobil Corp 2,440 %, due 8/16/2029	61	0,05
30	Exxon Mobil Corp 2,995 %, due 8/16/2039	31	0,03
40	Exxon Mobil Corp 4,114 %, due 3/1/2046	49	0,04
150	Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc, 144A, 5,500 %, due 5/1/2025	160	0,14
320	FirstEnergy Corp, Series B, 3,900 %, due 7/15/2027	344	0,31
280	FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, due 11/15/2031	402	0,36
370	Ford Motor Credit Co LLC, 8,125 %, due 1/15/2020	378	0,34
560	Ford Motor Credit Co LLC, 3,350 %, due 11/1/2022	563	0,50
300	Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, due 5/3/2029	310	0,28
450	Fox Corp, 144A, 5,476 %, due 1/25/2039	564	0,50
280	Freeport-McMoRan Inc,6,875 %, due 2/15/2023	295	0,26
240	General Electric Co 6,150 %, due 8/7/2037	284	0,25
30	General Electric Co 5,875 %, due 1/14/2038	35	0,03
1.080	General Electric Co 6,875 %, due 1/10/2039	1.378	1,23
130	General Motors Co 4,875 %, due 10/2/2023	140	0,13
140	General Motors Co 6,600 %, due 4/1/2036	163	0,15
20	General Motors Co 6,750 %, due 4/1/2046	24	0,02
70	General Motors Co 5,950 %, due 4/1/2049	78	0,07
180	Gilead Sciences Inc., 3,700 %, due 4/1/2024	191	0,17
100	Gilead Sciences Inc., 4,000 %, due 9/1/2036	114	0,10
40	Gilead Sciences Inc., 4,750 %, due 3/1/2046	49	0,04
660	Globale Zahlungen, Inc., 2,650 %, due 2/15/2025	664	0,59
250	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, due 10/21/2025	270	0,24
620	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, due 11/16/2026	650	0,58
110	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, due 5/1/2029 *	122	0,11
220	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, due 5/22/2045	267	0,24
120	Halliburton Co 5,000 %, due 11/15/2045	135	0,12
130	BCE Inc 4,125 %, due 6/15/2029	139	0,12
100	BCE Inc 5,125 %, due 6/15/2039	111	0,10
180	BCE Inc 5,500 %, due 6/15/2047	207	0,19
300	BCE Inc 5,250 %, due 6/15/2049	336	0,30
260	Hexcel Corp 3,950 %, due 2/15/2027	275	0,25
340	High Street Funding Trust I, 144A, 4,111 %, due 2/15/2028	373	0,33
130	Home Depot Inc/The, 2,125 %, due 9/15/2026	131	0,12
320	Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig am 12/6/2028	365	0,33
110	Humana Inc 2,900 %, due 12/15/2022	112	0,10
130	Humana Inc 3,850 %, due 10/1/2024	137	0,12
80	Humana Inc 3,950 %, due 3/15/2027	86	0,08
230	Humana Inc 3,125 %, due 8/15/2029	233	0,21
190	Humana Inc 4,950 %, due 10/1/2044	227	0,20
150	Huntington Ingalls Industries Inc., 3,483 %, due 12/1/2027	158	0,14
550	ILFC E-Capital Trust I, 144A, 4,090 %, due 12/21/2065 *	386	0,35
100	ILFC E-Capital Trust II, 144A, 4,340 %, due 12/21/2065 *	71	0,06
80	Jersey Central Power & Light Co, 144A, 4,300 %, due 1/15/2026	88	0,08
100	Johnson & Johnson 2,900 %, due 1/15/2028	106	0,09
30	Johnson & Johnson 3,700 %, due 3/1/2046	35	0,03
70	Johnson & Johnson 3,500 %, due 1/15/2048	79	0,07
380	JPMorgan Chase & Co, 4,005 %, due 4/23/2029 *	422	0,38
70	JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, due 7/23/2029 *	79	0,07
310	JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, due 12/5/2029 *	357	0,32
100	JPMorgan Chase & Co, 5,625 %, due 8/16/2043	137	0,12
160	JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, due 6/1/2045	206	0,18
140	JPMorgan Chase & Co, 4,260 %, due 2/22/2048 *	170	0,15
30	JPMorgan Chase & Co, 3,964 %, due 11/15/2048 *	35	0,03
120	Kerr-Mc Gee Corp, 6,950 %, due 7/1/2024	142	0,13
50	Kerr-Mc Gee Corp, 7,875 %, due 9/15/2031	69	0,06
100	Kinder Morgan Inc/DE, 5,300 %, fällig am 12/1/2034	117	0,10
320	KKR Group Finance Co III LLC, 144A, 5,125 %, due 6/1/2044	381	0,34
60	KKR Group Finance Co VI LLC, 144A, 3,750 %, due 7/1/2029	64	0,06
30	Kraft Heinz Foods Co, 3,000 %, fällig am 1.6.2026	30	0,03
30	Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig am 4. Juni 2042	31	0,03
230	L3Harris Technologies Inc, 4,854 %, due 4/27/2035	276	0,25
560	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig am 8/8/2024	572	0,51
100	Lennar Corp, 4,500 %, due 4/30/2024	107	0,10
70	Lennar Corp, 5,000 %, due 6/15/2027	75	0,07
680	Magellan Health Inc., 4,900 %, due 9/22/2024	682	0,61
140	Marriott International Inc/MD, 3,600 %, due 4/15/2024	148	0,13
80	Mars Inc, 144A, 2,700 %, due 4/1/2025	83	0,07
110	Mars Inc, 144A, 3,200 %, due 4/1/2030	117	0,10
140	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 4,900 %, due 4/1/2077	184	0,16
220	McDonald's Corp 3,700 %, due 1/30/2026	239	0,21
90	McDonald's Corp 4,450 %, due 3/1/2047	106	0,09
100	McDonald's Corp 4,450 %, due 9/1/2048	119	0,11
120	MDC Holdings Inc 6,000 %, due 1/15/2043	124	0,11
340	Microsoft Corp 3,450 %, due 8/8/2036	383	0,34
380	Microsoft Corp 4,100 %, due 2/6/2037	460	0,41
80	Microsoft Corp 3,700 %, due 8/8/2046	94	0,08
90	MidAmerican Energy Co, 3,650 %, due 4/15/2029	101	0,09
40	Molson Coors Brewing Co, 3,000 %, due 7/15/2026	41	0,04
80	Molson Coors Brewing Co, 4,200 %, due 7/15/2046	82	0,07
200	Morgan Stanley 3,737 %, due 4/24/2024 *	210	0,19
130	Morgan Stanley 4,375 %, due 1/22/2047	158	0,14
130	MPLX LP, 4,800 %, due 2/15/2029	145	0,13
270	MPLX LP, 4,500 %, due 4/15/2038	279	0,25
210	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, due 10/15/2027	225	0,20
130	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4,625 %, due 8/1/2029	135	0,12
80	New York Life Insurance Co, 144A, 4,450 %, due 5/15/2069	98	0,09
10	NGPL PipeCo LLC, 144A, 4,875 %, due 8/15/2027	11	0,01
110	Noble Energy Inc 5,250 %, due 11/15/2043	125	0,11
120	Norfolk Southern Railway Co, 7,875 %, due 5/15/2043	195	0,17
250	Northrop Grumman Corp, 4,030 %, due 10/15/2047	290	0,26
260	Northwest Acquisitions ULC/ Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, Due 11/1/2022	163	0,15
580	Northwest Pipeline LLC, 4,000 %, fällig am 1.4.2027	619	0,55
390	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,850 %, fällig am 30. September 2047	440	0,39
130	NRG Energy Inc, 144A, 3,750 %, due 6/15/2024	135	0,12

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
USA – (Fortsetzung)			
30	Nuveen Finance LLC, 144A, 4,125 %, due 11/1/2024	33	0,03
130	Nuveen LLC, 144A, 4,000 %, due 11/1/2028	147	0,13
130	Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, due 8/15/2026	131	0,12
240	Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, due 2/15/2027	238	0,21
120	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, due 8/15/2029	122	0,11
170	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, due 4/15/2046	174	0,16
120	Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, due 2/15/2047	119	0,11
150	PepsiCo Inc 2,625 %, due 7/29/2029	156	0,14
270	Pfizer Inc 3,000 %, due 12/15/2026	286	0,26
270	Philip Morris International Inc, 2,875 %, due 5/1/2024	277	0,25
160	Philip Morris International Inc, 6,375 %, due 5/16/2038	220	0,20
37	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 9,250 %, due 5/15/2023	39	0,03
80	Procter & Gamble Co/The, 3,500 %, due 10/25/2047	93	0,08
40	Range Resources Corp, 5,875 %, fällig am 1. Juli 2022	38	0,03
70	Range Resources Corp, 5,000 %, due 8/15/2022	66	0,06
100	Range Resources Corp, 4,875 %, due 5/15/2025	82	0,07
80	Raymond James Financial Inc, 4,950 %, due 7/15/2046	98	0,09
60	Republic Services Inc., 2,500 %, due 8/15/2024	61	0,05
480	Republic Services Inc., 3,375 %, due 11/15/2027	515	0,46
60	salesforce.com Inc., 3,700 %, due 4/11/2028	67	0,06
230	San Diego Gas & Electric Co, Serie RRR, 3,750 %, due 6/1/2047	253	0,23
190	Smithfield Foods Inc, 144A, 3,350 %, due 2/1/2022	191	0,17
10	Süd-Kalifornien Edison Co, 4,000 %, due 4/1/2047	11	0,01
160	Southern California Edison Co, Serie C, 4,125 %, due 3/1/2048	179	0,16
698	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 3,360 %, due 9/20/2021	702	0,63
330	Sunoco Logistics Partners Operations LP, 3,900 %, due 7/15/2026	342	0,31
560	Synchrony Financial, 2,850 %, due 7/25/2022	568	0,51
200	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,250 %, due 5/1/2023 4,250 %, due 11/15/2023	200	0,18
250	Target Corp 3,375 %, due 4/15/2029	274	0,25
110	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A 4,900 %, due 9/15/2044	139	0,12
160	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A 4,270 %, due 5/15/2047	187	0,17
190	Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, due 3/15/2027	236	0,21
60	Texas Instruments Inc., 2,900 %, fällig am 11/3/2027	64	0,06
120	Texas Instruments Inc., 2,250 %, fällig am 9/4/2029	121	0,11
450	Texas Instruments Inc, 3,875 %, due 3/15/2039	529	0,47
270	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig am 1. Juli 2038	347	0,31
70	Time Warner Cable LLC, 6,750 %, due 6/15/2039	86	0,08
254	Time Warner Entertainment Co LP, 8,375 %, due 7/15/2033	357	0,32
335	Transkontinentale Gasleitung Line Co LLC, 7,850 %, due 2/1/2026	429	0,38
460	Transkontinentale Gasleitung Co LLC, 7,250 %, due 12/1/2026	575	0,51
390	Transkontinentale Gasleitung Co LLC, 4,450 %, due 8/1/2042	433	0,39
220	Union Pacific Corp 4,375 %, due 9/10/2038	260	0,23
235	United Airlines 2014-1 Class B Pass Through Trust, Serie B, 4,750 %, due 4/11/2022	242	0,22
70	United Technologies Corp, 4,625 %, due 11/16/2048	88	0,08
30	UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, due 2/15/2024	32	0,03
310	UnitedHealth Group Inc, 2,375 %, due 8/15/2024	315	0,28
130	UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, due 12/15/2025	142	0,13
220	UnitedHealth Group Inc, 3,850 %, due 6/15/2028	245	0,22
220	UnitedHealth Group Inc, 2,875 %, due 8/15/2029	230	0,21
120	UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, due 8/15/2039	128	0,11
120	UnitedHealth Group Inc, 4,750 %, due 7/15/2045	150	0,13
30	UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, due 12/15/2048	36	0,03
120	US Bancorp, Series DMTN, 3,000 %, due 7/30/2029	126	0,11
132	Verizon Communications Inc, 4,329 %, due 9/21/2028	152	0,14
560	Verizon Communications Inc, 4,272 %, due 1/15/2036	643	0,57
10	Verizon Communications Inc, 5,250 %, due 3/16/2037	13	0,01
40	Verizon Communications Inc, 6,550 %, due 9/15/2043	59	0,05
60	Verizon Communications Inc, 4,125 %, due 8/15/2046	68	0,06
220	Verizon Communications Inc, 4,522 %, due 9/15/2048	265	0,24
70	Visa Inc., 3,650 %, due 9/15/2047	82	0,07
100	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual *	100	0,09
200	WALMART INC 4,050 %, due 6/29/2048	249	0,22
20	Walt Disney Co/The, 6,200 %, due 12/15/2034	28	0,03
30	Walt Disney Co/The, 6,400 %, due 12/15/2035	43	0,04
30	Walt Disney Co/The, 6,650 %, due 11/15/2037	45	0,04
50	Walt Disney Co/The, 5,400 %, due 10/1/2043	70	0,06
10	Walt Disney Co/The, 4,950 %, due 10/15/2045	14	0,01
10	Waste Management Inc, 3,200 %, due 6/15/2026	11	0,01
270	Waste Management Inc, 3,150 %, due 11/15/2027	288	0,26
300	Waste Management Inc, 4,000 %, due 7/15/2039	347	0,31
10	Wells Fargo & Co 3,000 %, due 10/23/2026	10	0,01
500	Wells Fargo & Co 3,196 %, due 6/17/2027 *	521	0,47
220	Wells Fargo & Co 4,300 %, due 7/22/2027	244	0,22
210	Wells Fargo & Co 3,584 %, due 5/22/2028 *	225	0,20
270	Wells Fargo & Co 4,150 %, due 1/24/2029	303	0,27
370	Wells Fargo & Co 5,375 %, due 11/2/2043	489	0,44
50	Wells Fargo & Co 4,900 %, due 11/17/2045	62	0,06
320	Wells Fargo & Co 4,750 %, due 12/7/2046	393	0,35
230	Western Midstream Betrieb LP, 3,950 %, due 6/1/2025	228	0,20
620	Western Midstream Operating LP, 4,650 %, due 7/1/2026	632	0,56
580	Western Midstream Operating LP, 4,750 %, due 8/15/2028	588	0,53
110	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, due 4/1/2044	102	0,09
130	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, due 8/15/2048	122	0,11
185	Whiting Petroleum Corp, 5,750 %, due 3/15/2021	174	0,16
230	Williams Cos Inc/The, 7,875 %, due 9/1/2021	254	0,23
190	Williams Cos Inc/The, 4,550 %, due 6/24/2024	206	0,18
40	Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, due 1/15/2031	53	0,05
90	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, due 3/15/2032	131	0,12
		65.383	58,47
Sambia – 0,49 % (28. February 2019: 0,57 %)			
174	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,000 %, due 2/15/2021	174	0,16
200	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, due 5/15/2022	196	0,17
200	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, due 3/1/2026	179	0,16
		549	0,49
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 91.124)		98.018	87,65
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 10,26 % 28. Februar 2019 9,81 %)			
Argentinien – 0,76 % (28. Februar 2019: 1,75 %)			
ARS 6.150	Argentina POM Politica Monetaria, Series POM, 66,777 %, due 6/21/2020 *	35	0,03
ARS 1.105	Argentine Bonos del Tesoro, 18,200 %, due 10/3/2021	6	0,01
390	Internationale Anleihe Der Regierung Der Argentinischen Republik, 5,875 %, due 1/11/2028	148	0,13
200	Internationale Anleihe Der Regierung Der Argentinischen Republik, 7,625 %, due 4/22/2046	78	0,07
120	Internationale Anleihe Der Regierung Der Argentinischen Republik, 6,875 %, due 1/11/2048	46	0,04
ARS 5.630	Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER, 4,000 %, due 3/6/2020 β	70	0,06
790	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144A, 9,125 %, due 3/16/2024	261	0,23
410	Provincia de Cordoba, 144A, 7,125 %, fällig am 6/10/2021	209	0,19
		853	0,76
Kolumbien – 0,20 % (28. Februar 2019: 0,44 %)			
200	Colombia Government International Bond, 4,500 %, due 3/15/2029	228	0,20

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Ecuador – 0,56 % (28. Februar 2019: 0,72 %)			
240	Ecuador Government International Bond, 144A, 9,650 %, due 12/13/2026	249	0,22
350	Ecuador Government International Bond, 144A, 10,750 %, due 1/31/2029	378	0,34
		627	0,56
Ägypten – 0,83 % (28. Februar 2019: 0,36 %)			
210	Egypt Government International Bond, 144A, 7,600 %, due 3/1/2029	227	0,20
200	Egypt Government International Bond, 144A, 8,700 %, due 3/1/2049	220	0,20
EGP 8.700	Egypt Treasury Bills, Series 273D, Call 120,50, due 3/24/2020	482	0,43
		929	0,83
Sambia – 0,14 % (28. February 2019: 0,00 %)			
150	El Salvador Government International Bond, 144A, 7,125 %, due 1/20/2050	154	0,14
Ghana – 0,45 % (28. Februar 2019: 0,20 %)			
250	Ghana Government International Bond, 144A, 8,627 %, due 6/16/2049	244	0,22
260	Ghana Government International Bond, 144A, 8,950 %, due 3/26/2051	256	0,23
		500	0,45
Israel – 0,36 % (28. Februar 2019: 0,31 %)			
360	Israel Government International Bond, 3,250 %, due 1/17/2028	397	0,36
Kenia – 0,21 % (28. Februar 2019: 0,20 %)			
230	Kenya Government International Bond, 144A, 8,250 %, due 2/28/2048	238	0,21
Kuwait – 0,52 % (28. Februar 2019: 0,63 %)			
530	Kuwait International Government Bond, 144A, 3,500 %, due 3/20/2027	583	0,52
Sambia – 0,59 % (28. February 2019: 0,00 %)			
340	Qatar Government International Bond, 144A, 3,375 %, due 3/14/2024	360	0,32
230	Qatar Government International Bond, 144A, 4,817 %, due 3/14/2049	297	0,27
		657	0,59
Russland – 0,24 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
RUB 18.110	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, due 5/23/2029	270	0,24
Vereinigte Arabische Emirate - 0,24 % 28. Februar 2019 0,35 %)			
210	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 4,125 %, due 10/11/2047	262	0,24
USA – 5,16 % (28. Februar 2019: 4,35 %)			
160	Alabama Economic Settlement Authority, 3,163 %, fällig am 15.09.2025	166	0,15
150	American Electric Power Co Inc 7,834 %, due 2/15/2041	253	0,23
210	Hafenbehörde von New York & New Jersey, 4,458 %, due 10/1/2062	275	0,25
210	Bundesstaat Kalifornien, 7,300 %, due 10/1/2039	334	0,30
150	Bundesstaat Illinois, 5,100 %, due 6/1/2033	163	0,15
60	United States Treasury Note/ Bond, 1,750 %, due 7/15/2022	60	0,05
400	United States Treasury Note/ Bond, 1,750 %, due 7/31/2024	407	0,36
2.890	United States Treasury Note/ Bond, Anleihe, 2,375 %, due 5/15/2029	3.115	2,78
780	United States Treasury Note/ Bond, Anleihe, 3,000 %, due 2/15/2049	961	0,86
30	United States Treasury Note/ Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	36	0,03
		5.770	5,16
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 12.648)		11.468	10,26
Investmentfonds - 1,10 % 28. Februar 2019 1,58 %)			
1.233	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	1.233	1,10
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 1.233)		1.233	1,10
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 105.005)		110.719	99,01
Devisenterminkontrakte – 0,00 % 28. Februar 2019 2,36 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		6	-
Futures – 0,03 % (28. Februar 2019: 0,04 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		31	0,03
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		110.756	99,04
Devisenterminkontrakte – (0,06 %) 28. Februar 2019 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(69)	(0,06)
Futures – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(2)	-
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		(71)	(0,06)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		110.685	98,98
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		1.140	1,02
Nettovermögen insgesamt		USD 111.825	100,00

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

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2018 beliefen sich diese Wertpapiere auf 66.000 USD und machten 22,43 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2018.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2018.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen

ARS – Argentinische Peso

EGP – Ägyptisches Pfund

EUR – Euro

RUB – Russische Rubel

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,66
Investmentfonds	1,10
Derivate	0,03
Sonstige Vermögenswerte	1,21
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	73.003	Verkauf	USD	88.908	USD	(38)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	308	Verkauf	USD	347		(7)
17.10.19	Barclays	Kauf	GBP	640	Verkauf	USD	804		(24)
17.10.19	JP Morgan	Kauf	USD	227	Verkauf	EUR	200		6
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): 2.754 USD)									6
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD–)									(69)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): 2.754 USD)								USD	(63)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) March 2019	15	USD 1.976	USD 8
U.S. 2 Year Note (CBT) March 2019	32	6.916	5
U.S. 5 Year Note (CBT) March 2019	56	6.719	11
U.S. Long Bond (CBT) March 2019	(30)	(4.958)	7
U.S. Ultra Bond (CBT) March 2019	(8)	(1.580)	(2)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 49			USD 31
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (5))			(2)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): 44 USD)			USD 29

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 8,21% (28. Februar 2019: 8,74 %)			
Supranational – 8,21 % (28. Februar 2019: 8,74 %)			
IDR 524.000.000	European Bank for Reconstruction & Development, 6,450%, due 12/13/2022	36.926	3,94
39.950	Inter-American Development Bank, 2,211%, due 10/9/2020 *	39.930	4,27
		76.856	8,21
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 77.421)		76.856	8,21
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 88,74% (28. Februar 2019: 88,65 %)			
Australien – 5,08 % (28. Februar 2019: 5,43 %)			
AUD 32.940	Australia Government Bond, Series 143, 2,750%, due 10/21/2019	22.237	2,38
AUD 6.250	New South Wales Treasury Corp, 4.000%, due 4/8/2021	4.420	0,47
AUD 14.230	Queensland Treasury Corp, Series 21, 5,500%, due 6/21/2021	10.375	1,11
AUD 15.510	Western Australian Treasury Corp, Series 19, 7,000%, due 10/15/2019	10.524	1,12
		47.556	5,08
Brasilien – 4,69 % (28. Februar 2019: 4,85 %)			
BRL 66.790	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10.000%, due 1/1/2023	17.689	1,89
BRL 96.360	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10.000%, due 1/1/2025	26.203	2,80
		43.892	4,69
Kolumbien – 4,68 % (28. Februar 2019: 3,05 %)			
COP 149.600.000	Colombian TES, Series B, 6,000%, due 4/28/2028	43.787	4,68
Malaysia – 2,01 % (28. Februar 2019: 4,24 %)			
MYR 20.295	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955%, due 9/15/2025	5.004	0,54
MYR 55.790	Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899%, due 11/16/2027	13.788	1,47
		18.792	2,01
Mexiko – 13,39 % (28. Februar 2019: 13,01 %)			
MXN 520.000	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500%, due 5/31/2029	28.704	3,06
MXN 177.000	Mexican Bonos, Series M, 7,750%, due 11/23/2034	9.236	0,99
MXN 556.000	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500%, due 11/18/2038	30.814	3,29
MXN 814.000	Mexican Bonos, Series M, 7,750%, due 11/13/2042	41.905	4,48
MXN 278.000	Mexican Bonos, Series M, 8.000%, due 11/7/2047	14.713	1,57
		125.372	13,39
Norwegen – 6,14 % (28. Februar 2019: 1,68 %)			
NOK 501.600	Norway Government Bond, Series 474, 144A, 3,750%, due 5/25/2021	57.530	6,14
Polen – 5,19 % (28. Februar 2019: 5,76 %)			
PLN 57.900	Republik Polen Government Bond, Series 0420, 1,500%, due 4/25/2020	14.583	1,56
PLN 87.540	Republik Polen Government Bond, Series 1020, 5,250%, due 10/25/2020	22.984	2,45
PLN 43.455	Republik Polen Government Bond, Series 0421, 2,000%, due 4/25/2021	11.004	1,18
		48.571	5,19
Südafrika – 4,05 % (28. Februar 2019: 6,00 %)			
ZAR 366.300	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500%, due 2/28/2041	16.999	1,81
ZAR 358.510	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750%, due 2/28/2048	20.943	2,24
		37.942	4,05
Großbritannien – 6,35 % (28. Februar 2019: 6,13 %)			
GBP 48.240	United Kingdom Gilt, 2,000%, due 7/22/2020	59.476	6,35
USA – 37,16 % (28. Februar 2019: 38,50 %)			
130.845	United States Treasury Floating Rate Note, 2,099%, due 4/30/2021 *	130.699	13,96
54.600	United States Treasury Note/Bond, 2,625%, due 2/15/2029	59.958	6,40
68.710	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, due 2/15/2049	84.638	9,04
60.270	United States Treasury Note/Bond, 2,875%, due 5/15/2049	72.613	7,76
		347.908	37,16
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 883.902)		830.826	88,74
Investmentfonds - 1,52% (28. Februar 2019: 1,57 %)			
14.234	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	14.234	1,52
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 14.234)		14.234	1,52
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 975.557)		921.916	98,47
Devisenterminkontrakte – 0,49% (28. Februar 2019: 0,97 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		4.620	0,49
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		926.536	98,96
Devisenterminkontrakte – (2,43%) (28. Februar 2019: (0,67 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(22.741)	(2,43)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(22.741)	(2,43)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten		903.795	96,53
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		32.459	3,47
Nettovermögen insgesamt		USD 936.254	100,00

– Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Registrierung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 31. August 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 57.530.000 oder 6,14 % des Nettovermögens.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

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

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,77
Investmentfonds	1,47
Derivate	0,48
Sonstige Vermögenswerte	4,28
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.03.19	BNY Mellon	Kauf	USD	56	Verkauf	EUR	51	USD –
09.03.19	BNY Mellon	Kauf	USD	185	Verkauf	GBP	150	–
09.03.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.267	Verkauf	USD	1.405	(12)
09.03.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
09.03.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	400	Verkauf	USD	488	(2)
09.04.19	BNY Mellon	Kauf	USD	57	Verkauf	EUR	52	–
09.04.19	BNY Mellon	Kauf	USD	61	Verkauf	GBP	51	–
09.04.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
09.04.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	20	Verkauf	USD	22	–
09.04.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–	–
09.04.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	92	Verkauf	USD	111	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.11.19	Barclays	Kauf	USD	10.453	Verkauf	ZAR	157.300	USD 96
09.11.19	Citi	Kauf	ZAR	21.900	Verkauf	USD	1.438	4
09.12.19	Barclays	Kauf	USD	3.764	Verkauf	EUR	3.340	90
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	9	Verkauf	AUD	12	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	AUD	–	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.178	Verkauf	AUD	5.288	(66)
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.199	Verkauf	AUD	3.254	8
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	959	Verkauf	AUD	1.723	2
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.081	Verkauf	CAD	4.595	(66)
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	9	Verkauf	CAD	10	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	930	Verkauf	CAD	1.498	2
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	CAD	–	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.128	Verkauf	CAD	2.824	6
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	5	Verkauf	DKK	39	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	249	Verkauf	DKK	2.050	7
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	831	Verkauf	DKK	6.219	(1)
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	579	Verkauf	DKK	3.844	12
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	DKK	4	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	234	Verkauf	EUR	156	1
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	NOK	154	Verkauf	EUR	13	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	DKK	252	Verkauf	EUR	33	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	47.145	Verkauf	EUR	41.956	996
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	MXN	368	Verkauf	EUR	14	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	NOK	47	Verkauf	EUR	5	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	174	Verkauf	EUR	40	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	JPY	222.161	Verkauf	EUR	1.883	22
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	MXN	1.051	Verkauf	EUR	47	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	49	Verkauf	EUR	31	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	EUR	–	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	1	Verkauf	EUR	–	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	ZAR	805	Verkauf	EUR	45	1
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	298	Verkauf	EUR	28	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	33	Verkauf	EUR	8	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	18.823	Verkauf	EUR	20.421	456
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	DKK	68	Verkauf	EUR	8	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	270	Verkauf	EUR	163	1
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	GBP	–	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	1	Verkauf	GBP	1	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	2	Verkauf	GBP	2	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	41	Verkauf	GBP	3	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	MXN	169	Verkauf	GBP	4	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	11	Verkauf	GBP	6	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	ZAR	68	Verkauf	GBP	2	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1.117	Verkauf	GBP	923	(3)
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	DKK	2	Verkauf	GBP	–	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	DKK	46	Verkauf	GBP	3	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	GBP	–	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	ZAR	60	Verkauf	GBP	1	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	25	Verkauf	GBP	15	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	7.362	Verkauf	GBP	6.034	12
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	31	Verkauf	GBP	3	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	2	Verkauf	GBP	–	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	NOK	–	Verkauf	GBP	–	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	JPY	29.654	Verkauf	GBP	232	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	NOK	29	Verkauf	GBP	2	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	28	Verkauf	GBP	15	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	10.183	Verkauf	GBP	9.390	(223)
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	11	Verkauf	GBP	7	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	MXN	58	Verkauf	GBP	2	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	JPY	5.460	Verkauf	GBP	43	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	25.320	Verkauf	JPY	2.682.295	52
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	92	Verkauf	JPY	11.715	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	36.657	Verkauf	JPY	4.364.407	(794)
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	JPY	–	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	11.012	Verkauf	JPY	1.422.057	9
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	862	Verkauf	MXN	17.008	15
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	12	Verkauf	MXN	229	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	372	Verkauf	MXN	9.037	9
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	1	Verkauf	MXN	61	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.240	Verkauf	MXN	27.456	(7)
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	NOK	2	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	USD	269	Verkauf	NOK	2.395	7
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	NOK	1	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	388	Verkauf	NOK	3.898	2

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	116	Verkauf	NOK	1.280	USD 3
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	2	Verkauf	PLN	11	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	PLN	2	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	279	Verkauf	PLN	1.328	12
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	934	Verkauf	PLN	4.037	13
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	647	Verkauf	PLN	2.487	22
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SEK	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	162	Verkauf	SEK	1.924	7
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	543	Verkauf	SEK	5.855	3
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	377	Verkauf	SEK	3.599	10
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	642	Verkauf	SGD	997	(12)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SGD	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	445	Verkauf	SGD	614	2
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	192	Verkauf	SGD	322	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SGD	1	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	18	Verkauf	USD	13	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	MXN	517	Verkauf	USD	26	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	141.243	Verkauf	USD	158.703	(3.353)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	68.669	Verkauf	USD	83.668	(74)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.851	Verkauf	USD	1.257	(10)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NOK	73	Verkauf	USD	8	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	76	Verkauf	USD	19	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	97	Verkauf	USD	65	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.129	Verkauf	USD	1.362	5
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	84	Verkauf	USD	63	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	DKK	116	Verkauf	USD	17	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	JPY	79.977	Verkauf	USD	752	2
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	ZAR	288	Verkauf	USD	19	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	110	Verkauf	USD	11	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	917	Verkauf	ZAR	15.415	(7)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	ZAR	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	273	Verkauf	ZAR	4.965	4
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	633	Verkauf	ZAR	9.479	9
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	2	Verkauf	ZAR	103	–
12.09.19	Citi	Kauf	USD	9.481	Verkauf	EUR	8.520	109
12.09.19	JP Morgan	Kauf	EUR	46.180	Verkauf	USD	52.760	(1.965)
13.09.19	HSBC	Kauf	USD	2.182	Verkauf	CLP	1.546.000	39
13.09.19	HSBC	Kauf	CLP	13.646.000	Verkauf	USD	19.891	(979)
17.09.19	HSBC	Kauf	USD	626	Verkauf	SEK	5.900	25
17.09.19	HSBC	Kauf	SEK	369.300	Verkauf	USD	39.385	(1.719)
17.09.19	National Australia Bank	Kauf	USD	1.624	Verkauf	SEK	15.600	33
20.09.19	Barclays	Kauf	USD	4.157	Verkauf	GBP	3.420	(8)
20.09.19	Citi	Kauf	GBP	48.980	Verkauf	USD	62.062	(2.414)
20.09.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.680	Verkauf	GBP	1.350	36
24.09.19	HSBC	Kauf	USD	20.657	Verkauf	NOK	178.100	1.101
24.09.19	HSBC	Kauf	NOK	260.800	Verkauf	USD	29.950	(1.313)
24.09.19	National Australia Bank	Kauf	USD	4.219	Verkauf	NOK	36.000	266
24.09.19	UBS	Kauf	USD	5.473	Verkauf	NOK	46.700	345
25.09.19	HSBC	Kauf	NZD	31.450	Verkauf	USD	20.936	(1.106)
26.09.19	Citi	Kauf	USD	993	Verkauf	CZK	22.600	35
26.09.19	JP Morgan	Kauf	CZK	468.800	Verkauf	USD	20.971	(1.107)
27.09.19	Citi	Kauf	USD	2.284	Verkauf	KRW	2.688.000	63
27.09.19	Citi	Kauf	KRW	48.148.000	Verkauf	USD	41.849	(2.050)
10.07.19	HSBC	Kauf	CLP	12.490.000	Verkauf	USD	18.019	(704)
10.10.19	Barclays	Kauf	USD	5.073	Verkauf	MYR	21.000	102
10.10.19	Barclays	Kauf	MYR	196.000	Verkauf	USD	47.414	(1.022)
18.10.19	HSBC	Kauf	SEK	127.700	Verkauf	USD	13.694	(642)
24.10.19	Morgan Stanley	Kauf	AUD	26.480	Verkauf	USD	18.720	(859)
25.10.19	JP Morgan	Kauf	IDR	107.200.000	Verkauf	USD	7.591	(98)
29.10.19	HSBC	Kauf	CLP	8.790.000	Verkauf	USD	12.828	(639)
11.08.19	Citi	Kauf	RUB	864.000	Verkauf	USD	13.102	(269)
13.11.19	HSBC	Kauf	CLP	8.790.000	Verkauf	USD	12.348	(157)
15.11.19	HSBC	Kauf	USD	28.060	Verkauf	ZAR	438.160	(552)
19.11.19	Citi	Kauf	USD	32.516	Verkauf	MXN	648.900	563
19.11.19	JP Morgan	Kauf	MXN	98.200	Verkauf	USD	4.913	(77)
22.11.19	Morgan Stanley	Kauf	AUD	43.310	Verkauf	USD	29.463	(227)
12.05.19	HSBC	Kauf	NZD	25.540	Verkauf	USD	16.334	(204)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 10.266)								4.620
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (7.041))								(22.741)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 3.225)								USD (18.121)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 0,62 % (28. Februar 2019: 0,55 %)			
EUR 2.425	Newgate Funding Plc, Series 2007 1X, Class BB, 0,000 %, due 12/1/2050 *	2.374	0,23
EUR 3.915	Newgate Funding Plc, Series 2007 2X, Class BB, 0,000 %, due 12/15/2050 *	3.887	0,39
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 6.211)		6.261	0,62
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 26,51 % (28. Februar 2019: 24,09 %)			
Australien – 1,59 % (28. Februar 2019: 2,54 %)			
15.850	National Australia Bank Ltd, 144A, 2,660 %, due 5/22/2020 *	15.903	1,59
Deutschland – 4,14 % (28. Februar 2019: 3,43 %)			
17.740	BMW US Capital LLC, 144A, 2.683 %, due 4/6/2020 *	17.768	1,77
23.865	Daimler Finance North America LLC, 144A, 2,600 %, due 2/22/2021 *	23.840	2,37
		41.608	4,14
USA – 20,78 % (28. Februar 2019: 17,18 %)			
12.600	American Express Co, 2.887 %, due 11/5/2021 *	12.672	1,26
23.495	Caterpillar Financial Services Corp, 2,640 %, due 3/15/2021 *	23.508	2,34
20.860	Citibank NA, 2,531 %, due 2/12/2021 *	20.888	2,08
7.090	Citigroup Inc, 3,128 %, due 1/10/2020 *	7.104	0,71
9.225	Ford Motor Credit Co LLC, 3,311 %, due 1/9/2020 *	9.241	0,92
21.080	Ford Motor Credit Co LLC, 3.099 %, due 4/5/2021 *	20.926	2,08
26.080	General Motors Financial Co Inc, 3,233 %, due 4/13/2020 *	26.151	2,61
42.130	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,898 %, due 2/23/2023 *	42.144	4,20
25.480	NBCUniversal Enterprise Inc, 144A, 2,719 %, due 4/1/2021 *	25.534	2,54
20.265	Wells Fargo & Co, 3,292 %, due 7/26/2021 *	20.526	2,04
		208.694	20,78
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 265.881)		266.205	26,51
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 71,45 % (28. Februar 2019: 71,06 %)			
Australien – 2,25 % (28. Februar 2019: 2,17 %)			
AUD 33.480	Australia Government Bond, Series 143, 2,750 %, due 10/21/2019	22.601	2,25
Brasilien – 4,64 % (28. Februar 2019: 4,70 %)			
BRL 83.955	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10.000 %, due 1/1/2021	21.363	2,13
BRL 91.105	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10.000 %, due 1/1/2027	25.231	2,51
		46.594	4,64
Kolumbien – 4,93 % (28. Februar 2019: 4,69 %)			
COP 169.100.000	Colombian TES, Series B, 6,000 %, due 4/28/2028	49.495	4,93
Indonesien – 4,03 % (28. Februar 2018: 3,92 %)			
IDR 424.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, due 3/15/2029	32.850	3,27
IDR 102.500.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR67, 8,750 %, due 2/15/2044	7.672	0,76
		40.522	4,03
Malaysia – 6,83 % (28. Februar 2019: 6,72 %)			
MYR 66.600	Malaysia Government Bond, Series 0315, 3,659 %, due 10/15/2020	15.940	1,59
MYR 76.000	Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, due 3/10/2022	18.394	1,83
MYR 72.345	Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, due 3/15/2023	17.369	1,73
MYR 25.410	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955 %, due 9/15/2025	6.265	0,63
MYR 42.820	Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899 %, due 11/16/2027	10.583	1,05
		68.551	6,83
Mexiko – 14,28 % (28. Februar 2019: 13,06 %)			
MXN 659.400	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, due 5/31/2029	36.399	3,63
MXN 204.000	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, due 11/23/2034	10.645	1,06
MXN 656.600	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, due 11/18/2038	36.389	3,62
MXN 960.000	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, due 11/13/2042	49.422	4,92
MXN 200.000	Mexican Bonos, Series M, 8.000 %, due 11/7/2047	10.585	1,05
		143.440	14,28
Polen – 4,41 % (28. Februar 2019: 5,34 %)			
PLN 109.100	Republik Polen Government Bond, Series 0420, 1,500 %, due 4/25/2020	27.479	2,73
PLN 30.095	Republik Polen Government Bond, Series 1020, 5,250 %, due 10/25/2020	7.902	0,79
PLN 35.315	Republik Polen Government Bond, Series 0421, 2,000 %, due 4/25/2021	8.942	0,89
		44.323	4,41
USA – 30,08 % (28. Februar 2019: 22,19 %)			
77.010	United States Treasury Floating Rate Note, 2,005 %, due 10/31/2020 *	76.882	7,65
12.855	United States Treasury Floating Rate Note, 2,075 %, due 1/31/2021 *	12.840	1,28
160.440	United States Treasury Floating Rate Note, 2,099 %, due 4/30/2021 *	160.261	15,96
43.230	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	52.083	5,19
		302.066	30,08
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 760.611)		717.592	71,45
Investmentfonds - 1,52 % (28. Februar 2019: 1,84 %)			
15.270	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	15.270	1,52
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 15.270)		15.270	1,52
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 1.047.973)		1.005.328	100,10
Devisenterminkontrakte – 0,22 % (28. Februar 2019: 0,85 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		2.178	0,22
Futures – 0,64 % (28. Februar 2019: 0,22 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		6.404	0,64
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		1.013.910	100,96
Devisenterminkontrakte – (2,30 %) (28. Februar 2019: 0,64 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(23.080)	(2,30)
Futures – (0,22 %) (28. Februar 2019: 0,36 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(2.195)	(0,22)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert finanzielle Verbindlichkeiten		(25.275)	(2,52)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete bewertete finanzielle Vermögenswerte		988.635	98,44
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		15.675	1,56
Gesamtnettovermögen		USD1.004.310	100,00

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

144A Von der Registrierung 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 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf 83.045.000 USD und machten 8,27 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

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

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,86
Investmentfonds	1,46
Derivate	0,82
Sonstige Vermögenswerte	2,86
Gesamtvermögen	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	61	Verkauf	GBP	50	USD	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–		–
11.09.19	Barclays	Kauf	USD	8.147	Verkauf	ZAR	122.600		75
11.09.19	HSBC	Kauf	ZAR	122.600	Verkauf	USD	8.073		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.295	Verkauf	EUR	2.045		45
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	174	Verkauf	GBP	144		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	GBP	2		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SEK	6		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	425.690	Verkauf	USD	288.952		(2.182)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	153.491	Verkauf	USD	172.410		(3.583)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	27.823	Verkauf	USD	33.884		(14)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	4.315	Verkauf	USD	450		(10)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	261.135	Verkauf	USD	189.265		(1.071)
12.09.19	Citi	Kauf	USD	10.148	Verkauf	EUR	9.120		117
12.09.19	JP Morgan	Kauf	USD	1.712	Verkauf	EUR	1.520		40
13.09.19	HSBC	Kauf	USD	3.431	Verkauf	CLP	2.432.000		61
13.09.19	HSBC	Kauf	CLP	16.392.000	Verkauf	USD	23.894		(1.175)
17.09.19	HSBC	Kauf	USD	13.925	Verkauf	SEK	131.200		544
17.09.19	HSBC	Kauf	SEK	595.100	Verkauf	USD	63.466		(2.769)
17.09.19	UBS	Kauf	SEK	29.400	Verkauf	USD	3.050		(51)
20.09.19	Citi	Kauf	GBP	8.250	Verkauf	USD	10.145		(99)
24.09.19	Goldman Sachs	Kauf	NOK	51.200	Verkauf	USD	5.721		(99)
24.09.19	HSBC	Kauf	USD	1.392	Verkauf	NOK	12.000		74
24.09.19	HSBC	Kauf	NOK	181.000	Verkauf	USD	20.786		(911)
25.09.19	HSBC	Kauf	NZD	29.790	Verkauf	USD	19.831		(1.048)
26.09.19	Citi	Kauf	CZK	26.100	Verkauf	USD	1.124		(18)
26.09.19	JP Morgan	Kauf	CZK	443.600	Verkauf	USD	19.845		(1.047)
27.09.19	Citi	Kauf	USD	80.284	Verkauf	JPY	8.556.000		(405)
27.09.19	Citi	Kauf	KRW	48.056.000	Verkauf	USD	41.665		(1.944)
27.09.19	Goldman Sachs	Kauf	JPY	808.000	Verkauf	USD	7.597		23
27.09.19	HSBC	Kauf	USD	104.107	Verkauf	JPY	11.032.000		67
07.10.19	HSBC	Kauf	CLP	10.370.000	Verkauf	USD	14.961		(585)
24.10.19	Citi	Kauf	GBP	4.860	Verkauf	USD	5.961		(34)
24.10.19	HSBC	Kauf	GBP	47.300	Verkauf	USD	59.192		(1.510)
24.10.19	Morgan Stanley	Kauf	AUD	32.290	Verkauf	USD	22.827		(1.047)
24.10.19	National Australia Bank	Kauf	USD	1.859	Verkauf	GBP	1.530		(7)
25.10.19	JP Morgan	Kauf	IDR	138.300.000	Verkauf	USD	9.793		(126)
29.10.19	HSBC	Kauf	CLP	8.780.000	Verkauf	USD	12.813		(639)
30.10.19	Citi	Kauf	PLN	29.810	Verkauf	USD	7.827		(331)
08.11.19	Citi	Kauf	RUB	849.000	Verkauf	USD	12.874		(264)
13.11.19	Citi	Kauf	USD	47.226	Verkauf	SGD	65.200		202
13.11.19	HSBC	Kauf	CLP	14.340.000	Verkauf	USD	20.164		(275)
13.11.19	JP Morgan	Kauf	USD	4.068	Verkauf	SGD	5.630		7
15.11.19	HSBC	Kauf	ZAR	224.400	Verkauf	USD	14.656		(3)
15.11.19	HSBC	Kauf	ZAR	265.590	Verkauf	USD	17.141		202
15.11.19	HSBC	Kauf	USD	31.379	Verkauf	ZAR	489.990		(617)
19.11.19	Citi	Kauf	USD	41.651	Verkauf	MXN	831.200		721
22.11.19	Morgan Stanley	Kauf	AUD	51.380	Verkauf	USD	34.946		(262)
05.12.19	HSBC	Kauf	NZD	32.910	Verkauf	USD	21.048		(262)
06.12.19	Goldman Sachs	Kauf	NOK	344.000	Verkauf	USD	38.507		(692)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 10.319)									2.178
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (7.763))									(23.080)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2.556)								USD	(20.902)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nomineller Wert (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)
Euro-BTP September 2019	893	USD 142.615	USD	6.024
Euro-Buxl 30 Year Bond December 2019	(450)	(110.122)		380
Euro-OAT September 2019	(258)	(48.318)		(2.195)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2.701)			USD	6.404
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (4.357))				(2.195)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (1.656))			USD	4.209

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 86,45% (28. Februar 2019: 76,28 %)			
Brasilien – 1,54 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
260	BRF SA, 144A, 3,950%, due 5/22/2023	259	1,54
Kanada – 2,21 % (28. Februar 2019: 3,75 %)			
200	Air Canada, 7,750%, due 4/15/2021	215	1,28
150	Methanex Corp, 5.250%, due 3/1/2022	156	0,93
		371	2,21
Ghana – 1,19 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
200	Tullow Oil Plc, 144A, 6,250%, due 4/15/2022	201	1,19
Irland – 1,24 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
200	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 6,000%, due 2/15/2025	210	1,24
Israel – 1,06 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
180	Teva Pharmaceutical Finance IV LLC, 2,250%, due 3/18/2020	179	1,06
Mexiko – 1,23 % (28. Februar 2019: 0,99 %)			
215	Petroleos Mexicanos, 4,250%, due 1/15/2025	206	1,23
Großbritannien – 1,98 % (28. Februar 2019: 1,90 %)			
310	Fiat Chrysler Automobiles NV, 5,250%, due 4/15/2023	332	1,98
USA – 73,38 % (28. Februar 2019: 68,64 %)			
335	AES Corp/VA, 4,000%, due 3/15/2021	343	2,04
220	AK Steel Corp, 7,500%, due 7/15/2023	223	1,33
290	Allegheny Technologies Inc, 5,950%, due 1/15/2021	298	1,77
150	Allegheny Technologies Inc, 7,875%, due 8/15/2023	161	0,96
175	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,875%, due 8/20/2026	191	1,13
240	Antero Resources Corp, 5.375%, due 11/1/2021	233	1,39
235	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,500%, due 3/15/2022	244	1,45
180	Boise Cascade Co, 144A, 5.625%, due 9/1/2024	188	1,11
140	California Resources Corp, 144A, 8,000%, due 12/15/2022	81	0,48
165	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 5.125%, due 5/1/2027	175	1,04
165	Centene Corp, 5,625%, due 2/15/2021	167	1,00
345	Chesapeake Energy Corp, 5,375%, due 6/15/2021	316	1,88
70	CIT Group Inc, 5,000%, due 8/15/2022	75	0,44
155	CIT Group Inc, 5.000%, due 8/1/2023	169	1,00
215	Clearway Energy Operating LLC, 5,000%, due 9/15/2026	219	1,30
235	Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 5.875%, due 6/1/2027	230	1,37
320	CommScope Inc, 144A, 6.000%, due 3/1/2026	328	1,95
330	CSC Holdings LLC, 5.250%, due 6/1/2024	354	2,10
250	CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp, 5,000%, due 3/15/2024	259	1,54
470	DaVita Inc, 5.000%, due 5/1/2025	472	2,81
155	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 7,125%, due 6/15/2024	163	0,97
180	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 6,020%, due 6/15/2026	203	1,21
150	DISH DBS Corp, 5,000%, due 3/15/2023	148	0,88
90	Edgewell Personal Care Co, 4,700%, due 5/19/2021	92	0,55
305	Encompass Health Corp, 5.750%, due 11/1/2024	310	1,84
340	Gray Television Inc, 144A, 5,125%, due 10/15/2024	352	2,09
50	Hughes Satellite Systems Corp, 6.625%, due 8/1/2026	54	0,32
175	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 144A, 6,250%, due 5/15/2026	183	1,09
210	Iron Mountain Inc, 144A, 5,250%, due 3/15/2028	219	1,30
200	Iron Mountain US Holdings Inc, 144A, 5.375%, due 6/1/2026	207	1,23
275	Koppers Inc, 6,000%, due 2/15/2025	269	1,60
90	LSC Communications Inc, 144A, 8,750%, due 10/15/2023	68	0,41
50	Navios Maritime Acquisition Corp / Navios Acquisition Finance US Inc, 144A, 8,125%, due 11/15/2021	41	0,24
175	NRG Energy Inc, 6,625%, due 1/15/2027	190	1,13
200	Perrigo Finance Unlimited Co, 3,900%, due 12/15/2024	205	1,22
350	PetSmart Inc, 144A, 5.875%, due 6/1/2025	345	2,05
170	Pitney Bowes Inc, 3.875%, due 10/1/2021	170	1,01
165	Qorvo Inc, 5,500%, due 7/15/2026	177	1,05
265	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 5.250%, due 12/1/2021	259	1,54
175	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 9.375%, due 4/1/2027	152	0,90
410	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu, 144A, 5,125%, due 7/15/2023	423	2,51
235	SBA Communications Corp, 4,875%, due 7/15/2022	239	1,42
100	Scientific Games International Inc, 6,625%, due 5/15/2021	102	0,61
50	Select Medical Corp, 144A, 6,250%, due 8/15/2026	52	0,31
50	Service Corp International/US, 5.125%, due 6/1/2029	54	0,32
140	Sinclair Television Group Inc, 144A, 5.625%, due 8/1/2024	145	0,86
190	Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,875%, due 3/15/2026	200	1,19
120	Sirius XM Radio Inc, 5,375%, due 7/15/2026	127	0,76
340	Sprint Capital Corp, 6,875%, due 11/15/2028	378	2,25
400	Sprint Corp, 7,250%, due 9/15/2021	431	2,56
315	Steel Dynamics Inc, 5.125%, due 10/1/2021	316	1,88
225	Symantec Corp, 144A, 5,000%, due 4/15/2025	227	1,35
420	Tenet Healthcare Corp, 4.500%, due 4/1/2021	435	2,58
165	Transocean Inc, 144A, 9,000%, due 7/15/2023	171	1,02
345	Univision Communications Inc, 144A, 5,125%, due 5/15/2023	342	2,03
160	ViaSat Inc, 144A, 5,625%, due 4/15/2027	170	1,01
		12.345	73,38
Sambia – 2,62% (28. February 2019: 1.00%)			
50	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,000%, due 2/15/2021	50	0,30
200	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250%, due 5/15/2022	195	1,16
200	First Quantum Minerals Ltd, 7,250%, due 5/15/2022	196	1,16
		441	2,62
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 14.327)		14.544	86,45
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 7,93% (28. Februar 2019: 3,87 %)			
Türkei – 3,02 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
660	Turkey Government International Bond, 4,875%, due 4/16/2043	508	3,02
USA – 4,91 % (28. Februar 2019: 1,95 %)			
685	United States Treasury Note/Bond, 2,875%, due 5/15/2049	826	4,91
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 1.318)		1.334	7,93
Schuldscheindarlehen – 1,30 % (28. Februar 2019: 1,89 %)			
225	PetSmart Inc, 6.210%, due 3/11/2022 *	219	1,30
Loan Notes insgesamt (Anschaffungskosten USD 204)		219	1,30
Investmentfonds - 1,17% (28. Februar 2019: 2,35 %)			
196	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	196	1,17
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 196)		196	1,17
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 16.045)		16.293	96,85
Credit Default Swaps – 2,50 % (28. Februar 2019: 1,15 %)			
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	420	2,50
Devisenterminkontrakte – 1,92 % (28. Februar 2019: 0,28 %)			
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	324	1,92
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		17.037	101,27
Credit Default Swaps – (0,11 %) (28. Februar 2019: 0,03 %))			
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(18)	(0,11)
Devisenterminkontrakte – (2,92 %) (28. Februar 2019: 0,34 %))			
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(492)	(2,92)
Futures – (0,03 %) (28. Februar 2019: 0,00 %)			
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(4)	(0,03)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		(514)	(3,06)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		16.523	98,21
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		300	1,79
Nettovermögen insgesamt		USD 16.823	100,00

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

144A Von der Registrierung 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 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf 5.698.000 USD und machten 33,86 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	84,22
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	1,16
Investmentfonds	1,04
Derivate	3,95
Sonstige Vermögenswerte	9,63
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kauf/Verkauf Schutz	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)	
Barclays	CCO Holdings LLC, 5.000%	Verkauf	20.06.21	180	USD	15
Barclays	Riginc Corp, 1.000%	Verkauf	20.06.21	195		(8)
Barclays	Sprint Communications Inc, 5.000%	Verkauf	20.06.21	365		28
Barclays	T-Mobile USA Inc, 5.000%	Verkauf	20.06.22	335		41
Citi	CDX.NA.HY, 5.000%	Verkauf	20.06.24	1.648		111
Citi	iTraxx Europe, 5.000%	Verkauf	20.06.24	1.410		171
Citi	Rite Aid Corporation, 5.000%	Verkauf	20.06.20	190		(10)
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5.000%	Verkauf	20.06.22	345		34
JP Morgan	AK Steel Corporation, 5.000%	Verkauf	20.06.20	185		5
JP Morgan	United States Steel Corp, 5.000%	Verkauf	20.06.21	180		12
Morgan Stanley	Dell Inc, 1.000%	Verkauf	20.06.22	280		2
Morgan Stanley	Dell Inc, 1.000%	Verkauf	20.06.22	185		1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 1.118)					USD	420
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (29))						(18)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 1.089)					USD	402

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
12.09.19	Barclays	Kauf	USD	5.423	Verkauf	EUR	4.780	USD	166
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	7	Verkauf	CHF	5		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CHF	–		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	1.707	Verkauf	EUR	1.144		24
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	2	Verkauf	EUR	3		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	188	Verkauf	GBP	116		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	4	Verkauf	SEK	25		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SEK	–		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	111	Verkauf	USD	84		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	9.820	Verkauf	USD	7.399		(22)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	14	Verkauf	USD	16		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–		–
12.09.19	Citi	Kauf	USD	4.479	Verkauf	EUR	4.020		57
12.09.19	Citi	Kauf	EUR	6.470	Verkauf	USD	7.349		(234)
12.09.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	3.652	Verkauf	EUR	3.250		77
12.09.19	Goldman Sachs	Kauf	EUR	350	Verkauf	USD	391		(6)
12.09.19	JP Morgan	Kauf	EUR	4.370	Verkauf	USD	4.993		(186)
12.09.19	Morgan Stanley	Kauf	EUR	1.630	Verkauf	USD	1.832		(39)
20.09.19	HSBC	Kauf	GBP	270	Verkauf	USD	331		(2)
27.11.19	HSBC	Kauf	EGP	17.000	Verkauf	USD	1.004		(3)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 270)									324
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (332))									(492)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (62))								USD	(168)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
U.S. Ultra Bond (CBT) December 2019	2	USD 395	USD	(4)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD–)			USD	–
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD–)				(4)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD–)			USD	(4)

^ *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^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 0,48% (28. Februar 2019: 0,46 %)			
433	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C04, Klasse 1M2, 7,045%, due 11/25/2024 *	471	0,08
1.040	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05, Klasse 1M2, 4,345%, due 1/25/2030 *	1.055	0,18
EUR 325	Fondo de Titulizacion de Activos UCI 17 17, Klasse A2, 0,000%, due 12/17/2049 *	331	0,06
EUR 813	GC Pastor Hipotecario 5 FTA 5, Class A2, 0,000%, due 6/21/2046 *	810	0,14
EUR 130	IM Pastor 4 FTA 4, Klasse A, 0,000%, due 3/22/2044 *	132	0,02
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 3.055)		2.799	0,48
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 10,34% (28. Februar 2019: 9,35 %)			
Deutschland – 1,85 % (28. Februar 2019: 1,63 %)			
10.715	Daimler Finance North America LLC, 144A, 2,600%, due 2/22/2021 *	10.704	1,85
USA – 8,49 % (28. Februar 2019: 7,72 %)			
6.335	American Express Co, 2.887%, due 11/5/2021 *	6.371	1,10
12.320	General Motors Financial Co Inc, 3,233%, due 4/13/2020 *	12.353	2,13
14.860	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,898%, due 2/23/2023 *	14.865	2,56
6.010	Hewlett Packard Enterprise Co, 6,350%, due 10/15/2045	6.981	1,20
8.615	Wells Fargo & Co, 3,292%, due 7/26/2021 *	8.726	1,50
		49.296	8,49
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 58.869)		60.000	10,34
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 86,41% (28. Februar 2019: 87,90 %)			
Australien – 5,76 % (28. Februar 2019: 5,45 %)			
AUD 24.200	Australia Government Bond, Series 143, 2,750%, due 10/21/2019	16.336	2,82
AUD 4.545	New South Wales Treasury Corp, 4.000%, due 4/8/2021	3.214	0,55
AUD 9.360	Queensland Treasury Corp, Series 21, 5,500%, due 6/21/2021	6.825	1,18
AUD 10.380	Western Australian Treasury Corp, Series 19, 7,000%, due 10/15/2019	7.043	1,21
		33.418	5,76
Brasilien – 4,52 % (28. Februar 2019: 4,97 %)			
BRL 39.710	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10.000%, due 1/1/2021	10.104	1,74
BRL 58.230	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10.000%, due 1/1/2027	16.127	2,78
		26.231	4,52
Kolumbien – 4,62 % (28. Februar 2019: 2,77 %)			
COP 37.100.000	Colombian TES, Series B, 6,250%, due 11/26/2025	11.224	1,93
COP 53.230.000	Colombian TES, Series B, 6,000%, due 4/28/2028	15.581	2,69
		26.805	4,62
Indonesien – 4,07 % (28. Februar 2019: 3,98 %)			
IDR 242.600.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000%, due 3/15/2029	18.796	3,24
IDR 64.900.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR67, 8,750%, due 2/15/2044	4.858	0,83
		23.654	4,07
Malaysia – 6,20 % (28. Februar 2019: 6,89 %)			
MYR 35.605	Malaysia Government Bond, Series 0315, 3,659%, due 10/15/2020	8.522	1,47
MYR 46.160	Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, due 3/10/2022	11.172	1,93
MYR 30.055	Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480%, due 3/15/2023	7.216	1,24
MYR 9.680	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955%, due 9/15/2025	2.386	0,41
MYR 27.070	Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899%, due 11/16/2027	6.690	1,15
		35.986	6,20
Mexiko – 13,22 % (28. Februar 2019: 13,00 %)			
MXN 309.700	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500%, due 5/31/2029	17.096	2,94
MXN 121.000	Mexican Bonos, Series M, 7,750%, due 11/23/2034	6.314	1,09
MXN 331.000	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500%, due 11/18/2038	18.344	3,16
MXN 503.300	Mexican Bonos, Series M, 7,750%, due 11/13/2042	25.910	4,46
MXN 172.000	Mexican Bonos, Series M, 8.000%, due 11/7/2047	9.103	1,57
		76.767	13,22
Norwegen – 2,95 % (28. Februar 2019: 1,78 %)			
11.582	Kommunalbanken AS, 144A, 2,740%, due 6/16/2020 *	11.612	2,00
NOK 47.800	Norway Government Bond, Series 474, 144A, 3,750%, due 5/25/2021	5.482	0,95
		17.094	2,95
Polen – 5,28 % (28. Februar 2019: 5,91 %)			
PLN 44.170	Republik Polen Government Bond, Series 0420, 1,500%, due 4/25/2020	11.125	1,92
PLN 49.175	Republik Polen Government Bond, Series 1020, 5,250%, due 10/25/2020	12.911	2,22
PLN 26.095	Republik Polen Government Bond, Series 0421, 2,000%, due 4/25/2021	6.608	1,14
		30.644	5,28
Südafrika – 4,04 % (28. Februar 2019: 6,06 %)			
ZAR 220.090	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500%, due 2/28/2041	10.200	1,76
ZAR 227.265	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750%, due 2/28/2048	13.276	2,28
		23.476	4,04
USA – 35,75 % (28. Februar 2019: 30,93 %)			
73.980	United States Treasury Floating Rate Note, 2,099%, due 4/30/2021 *	73.898	12,73
32.420	United States Treasury Note/Bond, 2,625%, due 2/15/2029	35.601	6,13
42.410	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, due 2/15/2049	52.241	9,00
38.030	United States Treasury Note/Bond, 2,875%, due 5/15/2049	45.818	7,89
		207.558	35,75
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 522.219)		501.633	86,41
Investmentfonds - 1,53% (28. Februar 2019: 1,04 %)			
8.861	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	8.861	1,53
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 8.861)		8.861	1,53
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 593.004)		573.293	98,76
Devisenterminkontrakte – 0,14% (28. Februar 2019: 0,78 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		813	0,14
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		574.106	98,90
Devisenterminkontrakte – (2,52%) (28. Februar 2019: (0,61 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(14.646)	(2,52)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(14.646)	(2,52)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verlust		559.460	96,38
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		21.059	3,62
Nettovermögen insgesamt		USD 580.519	100,00

– Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Registrierung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 31. August 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 27.798.000 oder 4,80 % des Nettovermögens.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

AUD – Australischer Dollar
BRL – Brasilianischer Real
COP – Kolumbianischer Peso
EUR – Euro
IDR – Indonesische Rupiah
MXN – Mexikanischer Peso
MYR – Malaysischer Ringgit
NOK – Norwegische Krone
PLN – Polnischer Zloty
ZAR – Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,67
Investmentfonds	1,49
Derivate	0,14
Sonstige Vermögenswerte	3,70
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	GBP	1	USD –
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	19	Verkauf	NZD	30	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	27	Verkauf	GBP	22	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	504	Verkauf	NZD	800	(1)
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	40	Verkauf	USD	44	–
11.09.19	Barclays	Kauf	USD	6.320	Verkauf	ZAR	95.100	58
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	37	Verkauf	AUD	55	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	AUD	2	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	5.156	Verkauf	AUD	4.938	(77)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	70	Verkauf	AUD	127	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	36	Verkauf	CAD	48	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CAD	2	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	13	Verkauf	CAD	11	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	4.986	Verkauf	CAD	4.287	(78)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	68	Verkauf	CAD	111	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	10	Verkauf	DKK	65	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	18	Verkauf	DKK	153	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	DKK	1	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	4	Verkauf	DKK	16	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.357	Verkauf	DKK	5.835	(6)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	258	Verkauf	EUR	147	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	705	Verkauf	EUR	627	15
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.365	Verkauf	EUR	1.478	32
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	98.107	Verkauf	EUR	56.542	(357)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NOK	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	MXN	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	JPY	143	Verkauf	GBP	1	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	JPY	7	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	MXN	1	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	2	Verkauf	GBP	2	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	DKK	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NOK	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	DKK	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	ZAR	1	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	15.677	Verkauf	GBP	8.328	(256)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	133	Verkauf	GBP	108	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	41	Verkauf	GBP	22	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	ZAR	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	–	Verkauf	GBP	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	1	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	59.457	Verkauf	JPY	4.080.753	(967)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	426	Verkauf	JPY	45.171	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	13	Verkauf	JPY	1.740	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	6	Verkauf	JPY	374	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	812	Verkauf	JPY	104.768	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	MXN	7	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	15	Verkauf	MXN	286	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	27	Verkauf	MXN	668	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	MXN	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	2.023	Verkauf	MXN	25.899	(14)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	8	Verkauf	NOK	93	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	NOK	1	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	3	Verkauf	NOK	13	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	NOK	40	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	630	Verkauf	NOK	3.627	(1)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	7	Verkauf	NZD	7	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NOK	18	Verkauf	NZD	3	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	19	Verkauf	NZD	3	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	42	Verkauf	NZD	44	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	71	Verkauf	NZD	136	3
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	ZAR	127	Verkauf	NZD	13	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	DKK	2	Verkauf	NZD	1	USD	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	38	Verkauf	NZD	43		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	680	Verkauf	NZD	1.057		14
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	JPY	34.938	Verkauf	NZD	515		6
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NOK	13	Verkauf	NZD	2		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	DKK	48	Verkauf	NZD	12		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	9	Verkauf	NZD	4		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	467	Verkauf	NZD	811		3
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	22	Verkauf	NZD	39		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	MXN	110	Verkauf	NZD	10		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	25	Verkauf	NZD	9		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	MXN	113	Verkauf	NZD	9		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	28	Verkauf	NZD	4		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	PLN	–		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	11	Verkauf	PLN	42		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.513	Verkauf	PLN	3.770		7
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	20	Verkauf	PLN	99		1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	6	Verkauf	PLN	15		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf	SEK	61		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	3	Verkauf	SEK	21		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	882	Verkauf	SEK	5.457		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	12	Verkauf	SEK	144		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	SGD	10		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	14	Verkauf	SGD	23		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SGD	–		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.044	Verkauf	SGD	933		(15)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	47	Verkauf	USD	57		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	310	Verkauf	USD	195		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	122.124	Verkauf	USD	79.129		(2.158)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	17	Verkauf	USD	19		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.699	Verkauf	USD	2.071		(3)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	ZAR	11		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.488	Verkauf	ZAR	14.406		(11)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	20	Verkauf	ZAR	364		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	11	Verkauf	ZAR	160		–
12.09.19	Citi	Kauf	USD	5.875	Verkauf	EUR	5.280		68
12.09.19	JP Morgan	Kauf	EUR	24.310	Verkauf	USD	27.774		(1.035)
13.09.19	HSBC	Kauf	CLP	8.609.000	Verkauf	USD	12.549		(617)
17.09.19	HSBC	Kauf	SEK	294.200	Verkauf	USD	31.330		(1.324)
20.09.19	Citi	Kauf	GBP	28.450	Verkauf	USD	36.035		(1.389)
24.09.19	HSBC	Kauf	NOK	43.900	Verkauf	USD	5.041		(221)
24.09.19	UBS	Kauf	USD	5.144	Verkauf	NOK	43.900		324
25.09.19	HSBC	Kauf	NZD	17.710	Verkauf	USD	11.790		(623)
26.09.19	JP Morgan	Kauf	CZK	264.100	Verkauf	USD	11.814		(623)
27.09.19	Citi	Kauf	KRW	27.122.000	Verkauf	USD	23.574		(1.155)
07.10.19	HSBC	Kauf	CLP	4.410.000	Verkauf	USD	6.362		(249)
24.10.19	HSBC	Kauf	GBP	29.500	Verkauf	USD	36.917		(942)
24.10.19	Morgan Stanley	Kauf	AUD	19.460	Verkauf	USD	13.757		(631)
25.10.19	JP Morgan	Kauf	IDR	68.000.000	Verkauf	USD	4.815		(62)
28.10.19	HSBC	Kauf	NOK	26.700	Verkauf	USD	2.969		(36)
29.10.19	HSBC	Kauf	CLP	6.280.000	Verkauf	USD	9.165		(457)
08.11.19	Citi	Kauf	RUB	490.000	Verkauf	USD	7.430		(153)
13.11.19	HSBC	Kauf	CLP	6.690.000	Verkauf	USD	9.398		(119)
15.11.19	HSBC	Kauf	USD	16.474	Verkauf	ZAR	257.250		(324)
19.11.19	Citi	Kauf	USD	16.055	Verkauf	MXN	320.400		278
22.11.19	Morgan Stanley	Kauf	AUD	18.700	Verkauf	USD	12.721		(98)
05.12.19	HSBC	Kauf	NZD	17.720	Verkauf	USD	11.333		(141)
06.12.19	Goldman Sachs	Kauf	NOK	250.100	Verkauf	USD	27.996		(503)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 5.081)									813
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (3.993))									(14.646)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 1.088)								USD	(13.833)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nenn- wert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 2,26% 28. Februar 2019 2,06%)			
Mexiko – 2,26% (28. Februar 2019: 2,06%)			
26.860	Petroleos Mexicanos, 6,625%, due 6/15/2035	26.256	1,56
12.535	Petroleos Mexicanos, 6.500%, due 6/2/2041	11.755	0,70
		38.011	2,26
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 36,568		38.011	2,26
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 92,44% 28. Februar 2019 92,42%)			
Australien – 2,94% (28. Februar 2019: 3,26%)			
AUD 73.140	Australische Regierung Bond, Serie 143, 2,750%, due 10/21/2019	49.374	2,94
Brasilien – 4,47% (28. Februar 2019: 4,67%)			
BRL 103.430	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series Ob, 10.000%, due 1/1/2021	26.318	1,57
BRL 176.000	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series Ob, 10.000%, due 1/1/2027	48.743	2,90
		75.061	4,47
Kolumbien – 6,69% (28. Februar 2019: 6,63%)			
COP 120.000.000	Kolumbianische TES, Serie B, 10,000%, due 7/24/2024	42.005	2,50
COP 35.690.000	Kolumbianische TES, Serie B, 6,250%, due 11/26/2025	10.798	0,64
COP 184.920.000	Kolumbianische TES, Serie B, 7,500%, due 8/26/2026	59.552	3,55
		112.355	6,69
Indonesien – 8,97% (28. Februar 2019: 8,88%)			
IDR 1.328.300.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR71, 9,000%, due 3/15/2029	102.912	6,13
IDR 639.700.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR68, 8,375%, due 3/15/2034	47.685	2,84
		150.597	8,97
Malaysia – 9,52% (28. Februar 2019: 9,70%)			
MYR 106.740	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0315, 3,659%, due 10/15/2020	28.833	1,52
MYR 132.475	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0416, 3,620%, due 11/30/2021	31.839	1,90
MYR 83.905	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0117, 3,882 %, due 3/10/2022	20.307	1,21
MYR 151.620	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0313, 3,480%, due 3/15/2023	36.403	2,17
MYR 40.675	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0115, 3,955%, due 9/15/2025	10.028	0,60
MYR 15.105	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0316, 3,900%, due 11/30/2026	3.725	0,22
MYR 62.770	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0417, 3,899%, due 11/16/2027	15.513	0,92
MYR 59.605	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0317, 4,762 %, due 4/7/2037	16.425	0,98
		159.788	9,52
Mexiko – 15,39% (28. Februar 2019: 11,20%)			
MXN 328.000	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750%, due 11/23/2034	17.116	1,02
MXN 1.487.000	Mexikanische Bonos, Serie M 30, 8,500%, due 11/18/2038	82.411	4,91
MXN 1.192.300	Mexican Bonos, Series M 20, 7,750%, due 11/13/2042	61.381	3,66
MXN 1.840.200	Mexican Bonos, Series M 20, 8.000%, due 11/7/2047	97.388	5,80
		258.296	15,39
Südafrika – 3,20% (28. Februar 2019: 4,36%)			
ZAR 499.000	Republik Südafrika Staatsanleihen, Serie R214, 6,500%, due 2/28/2041	23.126	1,38
ZAR 522.450	Republik Südafrika Staatsanleihen, Serie 2048, 8,750%, due 2/28/2048	30.520	1,82
		53.646	3,20
Großbritannien – 3,39% (28. Februar 2019: 3,79%)			
GBP 46.150	Vereinigtes Königreich Gilt, 2,000%, due 7/22/2020	56.899	3,39
USA – 37,87% (28. Februar 2019: 30,48%)			
160.870	US-Dollar Hinweis Zur Gleitrate, 2,075%, due 1/31/2021 *	160.676	9,57
297.585	US-Dollar Hinweis Zur Gleitrate, 2,099%, due 4/30/2021 *	297.254	17,71
62.600	US-Dollar Note/Bond, 3,000%, due 2/15/2049	77.112	4,59
83.670	US-Dollar Note/Bond, 2,875%, due 5/15/2049	100.804	6,00
		635.846	37,87
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 1,595,034)		1.551.862	92,44
Investmentfonds - 3,13% (28. Februar 2019 8,18%)			
52.508	Goldman Sachs London Liquid Reserves Fund - Institutionelle Klasse	52.508	3,13
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 52,508)		52.508	3,13
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 1.684.110)		1.642.381	97,83
Devisenterminkontrakte – 0,44% (28. Februar 2019 1,55%)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		7.394	0,44
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		1.649.775	98,27
Devisenterminkontrakte – (1,96%) (28. Februar 2019 0,70%)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(32.855)	(1,96)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(32.855)	(1,96)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten		1.616.920	96,31
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		61.874	3,69
Gesamtnettovermögen		USD 95.160	100,00

- Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2018.

ABKÜRZUNGEN:

AUD – Australischer Dollar
BRL – Brasilianischer Real
COP - Kolumbianischer Peso
GBP – Britisches Pfund
IDR – Indonesische Rupiah
MXN – Mexikanischer Peso
MYR – Malaysischer Ringgit
ZAR – Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,67
Investmentfonds	3,06
Derivate	0,43
Sonstige Vermögenswerte	3,84
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)
12.09.19	Barclays	Kauf	USD	31.686	Verkauf	ZAR	476.800	USD 290
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	150	Verkauf	AUD	221	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.697	Verkauf	AUD	2.822	(35)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	7.584	Verkauf	AUD	13.672	22
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.673	Verkauf	CAD	2.497	(36)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	7.478	Verkauf	CAD	12.102	13
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	148	Verkauf	CAD	196	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	734	Verkauf	CAD	658	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	33	Verkauf	CHF	32	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	165	Verkauf	CHF	109	2
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	377	Verkauf	CHF	412	(2)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.685	Verkauf	CHF	1.996	33
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	2.106	Verkauf	DKK	17.051	49
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	207	Verkauf	DKK	927	2

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	471	Verkauf	DKK	3.518	USD	(1)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	42	Verkauf	DKK	276		1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	3.006	Verkauf	EUR	2.674		65
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	14.955	Verkauf	EUR	8.992		184
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	152.407	Verkauf	EUR	165.303		3.714
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	7.707	Verkauf	GBP	7.106		(174)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	679	Verkauf	GBP	557		1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	3.380	Verkauf	GBP	1.875		(6)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	HKD	33		-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	211	Verkauf	HKD	2.013		-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	21	Verkauf	HKD	109		-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	47	Verkauf	HKD	415		(1)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	10.335	Verkauf	JPY	740.124		(10)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.077	Verkauf	JPY	220.079		4
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	105.326	Verkauf	JPY	13.606.066		49
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	23.567	Verkauf	JPY	2.806.359		(514)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	19	Verkauf	NOK	166		-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	949	Verkauf	NOK	10.269		27
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	93	Verkauf	NOK	559		1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	212	Verkauf	NOK	2.120		1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	15	Verkauf	NZD	22		-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	165	Verkauf	NZD	286		1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	737	Verkauf	NZD	1.387		23
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	72	Verkauf	NZD	75		1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.369	Verkauf	SEK	15.935		41
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	27	Verkauf	SEK	258		1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	134	Verkauf	SEK	867		2
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	306	Verkauf	SEK	3.288		2
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	377	Verkauf	SGD	585		(7)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.685	Verkauf	SGD	2.837		7
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	165	Verkauf	SGD	154		-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	33	Verkauf	SGD	46		-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	23.567	Verkauf	USD	26.499		(576)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	105.326	Verkauf	USD	128.439		(221)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	10.335	Verkauf	USD	6.987		(25)
12.09.19	Citi	Kauf	USD	22.338	Verkauf	EUR	19.960		383
12.09.19	JP Morgan	Kauf	EUR	54.200	Verkauf	USD	61.922		(2.307)
17.09.19	Citi	Kauf	USD	5.237	Verkauf	INR	369.000		91
17.09.19	Citi	Kauf	INR	3.890.000	Verkauf	USD	55.502		(1.253)
17.09.19	HSBC	Kauf	USD	26.046	Verkauf	SEK	245.400		1.017
17.09.19	HSBC	Kauf	SEK	276.400	Verkauf	USD	29.477		(1.286)
20.09.19	Citi	Kauf	GBP	13.760	Verkauf	USD	16.921		(164)
24.09.19	HSBC	Kauf	NOK	212.300	Verkauf	USD	24.380		(1.069)
27.09.19	Citi	Kauf	KRW	39.916.000	Verkauf	USD	34.694		(1.700)
10.10.19	HSBC	Kauf	BRL	199.170	Verkauf	USD	51.955		(3.983)
11.10.19	Citi	Kauf	PLN	379.940	Verkauf	USD	100.301		(4.794)
18.10.19	HSBC	Kauf	SEK	494.500	Verkauf	USD	53.027		(2.486)
22.10.19	HSBC	Kauf	KRW	133.410.000	Verkauf	USD	113.436		(3.067)
24.10.19	HSBC	Kauf	GBP	85.000	Verkauf	USD	106.371		(2.714)
28.10.19	HSBC	Kauf	NOK	66.600	Verkauf	USD	7.407		(89)
29.10.19	HSBC	Kauf	CLP	22.960.000	Verkauf	USD	33.507		(1.670)
29.10.19	HSBC	Kauf	THB	1.063.200	Verkauf	USD	34.524		306
08.11.19	Citi	Kauf	RUB	6.385.000	Verkauf	USD	96.823		(1.986)
13.11.19	Citi	Kauf	USD	28.843	Verkauf	SGD	39.820		124
13.11.19	HSBC	Kauf	CLP	29.750.000	Verkauf	USD	41.793		(530)
15.11.19	HSBC	Kauf	USD	20.103	Verkauf	ZAR	313.920		(395)
19.11.19	Citi	Kauf	USD	54.093	Verkauf	MXN	1.079.500		936
22.11.19	Morgan Stanley	Kauf	AUD	119.880	Verkauf	USD	81.552		(629)
06.12.19	Goldman Sachs	Kauf	NOK	559.400	Verkauf	USD	62.619		(1.125)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 30.178)									7.394
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (13.725))									(32.855)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 16.453)								USD	(25.461)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventarwerts
Asset-Backed Securities – 10,14 % (28. Februar 2019 12,09 %)			
804	Forderungsbesicherte Wertpapiere Home Equity Loan Trust Serie 2004-HE5, Serie 2004 DNA 2. Class M1. 3,045 %, due 8/25/2034 *	799	0,83
754	Centex Home Equity Loan Trust 2005-A, Serie 2005 A, Klasse M1, 2,865 %, due 1/25/2035 *	756	0,78
1.943	CWABS Rovolving Home Equity Loan Trust Series 2004-I, Serie 2004 I, Klasse A, 2,485 %, due 2/15/2034 *	1.937	2,00
977	Long Beach Hypothekendarlehen Trust 2005-WL2, Serie 2005 DNA 2. Class M2. 2,880 %, due 8/25/2035 *	983	1,01
1.113	Merrill Lynch Hypothek Investors Trust Serie 2006-HE1, Serie 2006 DNA 2. Class M1. 2,535 %, due 12/25/2036 *	1.113	1,15
1.556	Neues Jahrhundert Home Equity Loan Trust Series 2005-B, Serie 2005 B, Klasse A2D, 2,545 %, due 10/25/2035 *	1.564	1,61
2.323	Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Serie 2017 4, Klasse A1, 144A, 2,750 %, due 6/25/2057 *	2.359	2,44
299	Towd Point Mortgage Trust 2018-3, Serie 2018 3, Klasse A1, 144A, 3,750 %, due 5/25/2058 *	314	0,32
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 9.711)		9.825	10,14
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 7,55 % (28. Februar 2019 8,91 %)			
1.050	FREMF 2014-K717 Hypothek LDP 12. Ser ies 2014 K717. Klasse 144A, 3,753 %, due 11/25/2047 *	1.079	1,11
1.631	Lehman XS Trust Serie 2005-5N, Serie 2005 Klasse 1A1, 2,445 %, due 11/25/2035 *	1.641	1,69
1.975	Thornburg Hypothekenpapiere Vertrauen 2004-2, Serie 2004 2, Klasse A1, 2,765 %, due 6/25/2044 *	1.972	2,04
2.511	WaMu Hypothek Durchlaucht Serie 2004-AR5 Trust, Series 2004 AR5, Class A6, 144A, 4,668 %, due 6/25/2034 *	2.626	2,71
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 7.206)		7.318	7,55
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 44,49 % (28. Februar 2019 38,93 %)			
Kanada – 1,55 % (28. Februar 2019: 1,46 %)			
1.495	Methanex Corp, 3,250 %, due 12/15/2019	1.496	1,55
Großbritannien – 1,59 % (28. Februar 2019: 1,42 %)			
1.440	FIAT Chrysler Automobiles NV, 5,250 %, due 4/15/2023	1.543	1,59
USA – 41,35 % (28. Februar 2019: 33,40 %)			
730	American Tower Corp 2,250 %, due 1/15/2022	733	0,76
770	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,625 %, due 5/20/2024	821	0,85
1.920	Targa Resources Corp 5,375 %, due 11/1/2021	1.867	1,93
405	Ares Capital Corp 4,250 %, due 3/1/2025	420	0,43
1.035	Bank of America Corp 2,503 %, due 10/21/2022	1.045	1,08
880	Bank of America Corp 4,200 %, due 8/26/2024	950	0,98
330	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,500 %, due 3/15/2022	342	0,35
650	Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, due 3/15/2024	688	0,71
405	Boeing Co/The, 2,700 %, due 5/1/2022	413	0,43
695	Boise Cascade Co, 144A, 5,625 %, due 9/1/2024	725	0,75
1.975	Bristol-Myers Squibb Co 2,600 %, due 5/16/2022	2.013	2,08
510	Broadcom Inc, 144A, 3,125 %, due 10/15/2022	517	0,53
490	Broadcom Inc, 144A, 3,625 %, due 10/15/2024	497	0,51
1.405	CF Industries Inc, 144A, 3,400 %, due 12/1/2021	1.431	1,48
1.600	GSI Group Inc 5,000 %, due 8/15/2022	1.710	1,76
975	Citigroup Inc 3,500 %, due 5/15/2023	1.015	1,05
1.035	Colorado Interstate Gas Co LLC/Colorado Interstate Ausstellende Firma, 144A, 4,150 %, due 8/15/2026	1.101	1,14
190	Crown Castle International Corp. Corp., 3,700 %, due 6/15/2026	202	0,21
1.805	Dell International LLC/EMC Corp, 144A, 6,020 %, due 6/15/2026	2.038	2,10
581	BCE Inc 7,250 %, due 10/15/2021	625	0,64
880	Equinix Inc 5,375 %, due 4/1/2023	901	0,93
406	FS KKKR Capital Corp, 4,750 %, due 5/15/2022	418	0,43
220	FS KKKR Capital Corp, 4,625 %, due 7/15/2024	224	0,23
190	General Electric Co 3,100 %, due 1/9/2023	191	0,20
395	BCE Inc 4,750 %, due 5/1/2023	425	0,44
960	Iron Mountain Inc., 6,000 %, due 8/15/2023	984	1,02
490	Iron Mountain Inc, 144A, 5,250 %, due 3/15/2028	511	0,53
1.100	Iron Mountain US Holdings Inc., 144A 5,375 %, due 6/1/2026	1.141	1,18
985	JPMorgan Chase & Co 3,200 %, due 1/25/2023	1.024	1,06
655	JPMorgan Chase & Co 3,125 %, due 1/23/2025	683	0,70
1.540	Kraft Heinz Foods Co, 3,500 %, due 6/6/2022	1.577	1,63
500	Kraft Heinz Foods Co, 3,500 %, due 7/15/2022	511	0,53
475	Brands Inc 6,625 %, due 4/1/2021	502	0,52
260	Brands Inc 5,625 %, due 10/15/2023	274	0,28
780	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, due 2/1/2030	829	0,85
960	Morgan Stanley 2,750 %, due 5/19/2022	977	1,01
1.010	PetSmart Inc, 144A, 5,875 %, due 6/1/2025	995	1,03
1.560	Philip Morris International Inc, 2,375 %, due 8/17/2022	1.574	1,62
283	Frontier Communications Corp, 4,875 %, due 7/15/2022	288	0,30
440	Abgedichtete Luftkorp, 5,250 %, due 4/1/2023	471	0,49
2.235	Sprint Corp, 7,250 %, due 9/15/2021	2.410	2,49
705	Steel Dynamics Inc 5,125 %, due 10/1/2021	708	0,73
965	Symantec Corp, 144A, 5,000 %, due 4/15/2025	972	1,00
1.005	Wells Fargo & Co 2,625 %, due 7/22/2022	1.022	1,05
1.235	WR Grace & Co-Conn, 144A, 5,125 %, due 10/1/2021	1.288	1,33
		40.053	41,35
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 42.282)		43.092	44,49
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 41,33 % (28. Februar 2019 46,32 %)			
Australien – 1,26 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
AUD 1.350	Australische Staatsanleihen, Serie 150, 3,000 %, due 3/21/2047	1.223	1,26
Brasilien – 2,02 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
BRL 7.390	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series Ob, 10,000 %, due 1/1/2023	1.957	2,02
Kanada – 1,16 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
CAD 1.135	Kanadische Regierung Anleihe, 2,750 %, due 12/1/2048	1.122	1,16
Frankreich – 4,78 % (28. Februar 2019: 10,32 %)			
EUR 2.905	FRENCH REPUBLIC Staatsanleihen OAT, 144A 2,000 %, due 5/25/2048	4.624	4,78
Japan – 1,84 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
JPY 176.000	Japanische Regierung Dreißig Jahresanleihe, Serie 63, 0,400 %, due 6/20/2049	1.781	1,84
Mexiko – 2,04 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
MXN 35.800	Mexikanische Bonos, Serie M 20, 8,500 %, due 5/31/2029	1.976	2,04
Großbritannien – 3,43 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
GBP 2.440	Vereinigtes Königreich Gilt, 1,500 %, due 7/22/2047	3.324	3,43
USA – 24,80 % (28. Februar 2019: 22,08 %)			
10.375	United States Treasury Note/ Bond, Anleihe, 2,375 %, due 5/15/2029	11.183	11,54
10.660	United States Treasury Note/ Bond, Anleihe, 2,875 %, due 5/15/2049	12.843	13,26
		24.026	24,80
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 38.900		40.033	41,33
Investmentfonds - 2,89 % (28. Februar 2019 2,48 %)			
2.795	Goldman Sachs London Liquid Reserves Fund - Institutionelle Klasse	2.795	2,89
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 2.795)		2.795	2,89
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 3.096)		103.063	106,40
Credit Default Swaps – 1,66 % (28. Februar 2019 0,20 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.611	1,66
Devisenterminkontrakte – 1,26 % (28. Februar 2019 0,96 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.221	1,26
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		105.895	109,32
Credit Default Swaps – 0,00 % (28. Februar 2019 0,07 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(6)	-
Devisenterminkontrakte – (2,69 %) (28. Februar 2019 0,46 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(2.607)	(2,69)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(2.613)	(2,69)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten		103.282	106,63
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(6.416)	(6,63)
Nettovermögen insgesamt	USD	96.866	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

- Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Registrierung befreite Wertpapiere gemäß Regel 144A von Das Securities Act von 1933 in der geänderten Fassung. Diese Wertpapiere dürfen nur weiterverkauft werden, bei Transaktionen ausgenommen Von der Registrierung bis hin zu qualifizierten institutionellen Käufern. Zum August 2019 betrugen diese Wertpapiere USD 22.635.000 und machten 23,37% des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2018.

ABKÜRZUNGEN:

AUD - Australischer Dollar
BRL - Brasilianischer Real
CAD - Kanadischer Dollar
EUR - Euro
GBP - Britisches Pfund
JPY - Japanischer Yen
MXN - Mexikanischer Peso

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,54
Investmentfonds	2,61
Derivate	2,64
Sonstige Vermögenswerte	1,21
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kauf/Verkauf Schutz	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Barclays	CCO Holdings LLC, 5,000 %	Verkauf	20.6.21	900	USD 76
Barclays	GT Corp, 5,000 %	Verkauf	20.6.22	1.725	172
Barclays	Sprint Communications Inc	Verkauf	20.6.21	1.915	148
Citi	Markit iTraxx Europe, 5,000 %	Verkauf	20.6.24	8.190	993
JP Morgan	Liberty Media LLC, 5,000 %	Verkauf	20.6.22	1.700	212
Morgan Stanley	Dell Inc., 1,000 %	Verkauf	20.6.22	715	4
Morgan Stanley	Dell Inc., 1,000 %	Verkauf	20.6.22	1.115	6
Morgan Stanley	Dell Inc., 1,000 %	Verkauf	20.12.22	1.925	(6)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 204)					USD 1.611
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (68))					(6)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 136)					USD 1.605

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	EUR	1	USD –
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	SGD	3	-
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	13	Verkauf	USD	15	-
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	EUR	1	-
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	SGD	-	-
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	59	Verkauf	USD	66	-
12.09.19	Barclays	Kauf	USD	11.021	Verkauf	EUR	9.710	341
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	680	Verkauf	EUR	609	9
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	14	Verkauf	GBP	12	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	GBP	-	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	17	Verkauf	SGD	24	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	61.099	Verkauf	USD	68.626	(1.424)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	35.789	Verkauf	USD	3.731	(82)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	-	Verkauf	USD	-	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	297	Verkauf	USD	201	(2)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	4.218	Verkauf	USD	5.137	(2)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	602	Verkauf	USD	434	(2)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	3	Verkauf	USD	2	-
12.09.19	Citi	Kauf	USD	1.159	Verkauf	EUR	1.040	15
12.09.19	Citi	Kauf	EUR	11.110	Verkauf	USD	12.544	(323)
12.09.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	6.531	Verkauf	EUR	5.840	107
12.09.19	Goldman Sachs	Kauf	EUR	1.900	Verkauf	USD	2.122	(32)
12.09.19	HSBC	Kauf	EUR	1.950	Verkauf	USD	2.187	(42)
12.09.19	JP Morgan	Kauf	USD	15.521	Verkauf	EUR	13.780	364
12.09.19	JP Morgan	Kauf	EUR	8.980	Verkauf	USD	10.138	(260)
12.09.19	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.011	Verkauf	EUR	1.790	42
12.09.19	National Australia Bank Ltd	Kauf	EUR	3.570	Verkauf	USD	4.036	(109)
13.09.19	Goldman Sachs	Kauf	CHF	1.930	Verkauf	USD	1.979	(27)
13.09.19	JP Morgan	Kauf	USD	1.963	Verkauf	CHF	1.930	11
20.09.19	Citi	Kauf	USD	4.064	Verkauf	GBP	3.190	180
20.09.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.122	Verkauf	GBP	880	50
20.09.19	HSBC	Kauf	GBP	4.070	Verkauf	USD	5.187	(231)
20.09.19	JP Morgan	Kauf	USD	1.162	Verkauf	GBP	950	5
20.09.19	National Australia Bank Ltd	Kauf	USD	2.087	Verkauf	GBP	1.720	(7)
27.09.19	Citi	Kauf	USD	6.458	Verkauf	JPY	689.000	(39)
27.09.19	Morgan Stanley	Kauf	JPY	689.000	Verkauf	USD	6.433	65
27.09.19	National Australia Bank Ltd	Kauf	USD	1.561	Verkauf	JPY	166.000	(4)
21.10.19	HSBC	Kauf	USD	1.097	Verkauf	CAD	1.460	(1)
24.10.19	HSBC	Kauf	USD	1.195	Verkauf	AUD	1.760	8
19.11.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.836	Verkauf	MXN	36.800	24
27.11.19	HSBC	Kauf	EGP	104.500	Verkauf	USD	6.169	(20)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 981)								1.221
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (472))								(2.607)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 509)								USD (1.386)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettovermögenswert
Asset-Backed Securities – 8,98 % (28. Februar 2019 33,70 %)			
1.189	Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Serie 2017 4, Klasse A1, 144A, 2,750 %, due 6/25/2057 *	1.208	2,85
1.125	Towd Point Mortgage Trust 2017-5, Serie 2017 5, Klasse A1, 144A, 2,745 %, due 2/25/2057 *	1.123	2,66
535	Towd Point Mortgage Trust 2017-6, Serie 2017 6, Klasse A1, 144A, 2,750 %, due 10/25/2057 *	543	1,28
891	Aussteller Von Vantage Data Centern LLC, Serie 2018 1A, Klasse A2, 144A, 4,072 %, due 2/16/2043	928	2,19
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 3.716)		3.802	8,98
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere – 73,48 % (28. Februar 2019 49,49 %)			
EUR 1.400	Bancaja 10 FTA 10, Klasse C, 0,079 %, due 5/22/2050 *	1.270	3,00
953	Bear Stearns Alt-A Trust 2004-12, Serie 2004 12, Klasse 1A1, 2,845 %, due 1/25/2035 *	969	2,29
825	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC, Serie 2017 BIOC, Klasse B, 144A 3,165 %, due 7/15/2032 *	826	1,95
815	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust, Serie 2014 CR15, Klasse B, 4,848 %, due 2/10/2047 *	908	2,14
840	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust, Serie 2014 OPT 1. Class 144A. 4,898 %, due 2/10/2047 *	905	2,14
2.270	COMM 2015-CCRE26 Mortgage Trust, Serie 2015 LDP 9. Class AM. 4,085 %, due 10/10/2048 *	2.493	5,89
2.000	Comm 2015-LC21 Hypothek LDP 12. Series 2015 LC21. Klasse AMFX, 4,043 %, due 7/10/2048 *	2.178	5,15
1.570	Comm 2015-LC21 Hypothek LDP 12. Series 2015 LC21. Klasse D 4,443 %, due 7/10/2048 *	1.597	3,77
435	Kommerzielle Hypothek Lease-Backed-Zertifikate Serie 2001-CMLB-1, Serie 2001 CMLB, Klasse D, 144A 8,053 %, due 6/20/2031 *	470	1,11
235	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C06, Class 2M2, 144A, 4,245 %, due 3/25/2031 *	236	0,56
50.022	Freddie Mac Multifamilie Strukturierte Durchleitung Zertifikate K027, Klasse X1, 0,887 %, due 1/25/2023 *	1.093	2,58
38.797	Freddie Mac Multifamilie Strukturierte Durchleitung Zertifikate K042, Klasse X1, 1,179 %, due 12/25/2024 *	1.849	4,37
990	FREMF 2014-K717 Hypothek LDP 12. Series 2014 K717. Klasse 144A, 3,753 %, due 11/25/2047 *	1.010	2,38
162	FREMF 2015-KF12 Hypothek LDP 12. Series 2015 KF12. Klasse 144A, 9,324 %, due 9/25/2022 *	172	0,41
790	FREMF 2017-K61 Hypothek LDP 12. Series 2017 K61. Klasse 144A, 3,809 %, due 12/25/2049 *	818	1,93
530	FREMF 2017-K724 Hypothek LDP 12. Series 2017 K724. Klasse 144A, 3,599 %, due 11/25/2023 *	546	1,29
EUR 700	Im Pastor 4 FTA 4, Klasse B, 0,000 %, due 3/22/2044 *	496	1,17
1.330	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C15, Series 2013 C15, Class A1, 144A, 5,371 %, due 11/15/2045 *	1.459	3,45
1.580	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C32, Series 2015 C32, Class A1, 144A, 4,816 %, due 11/15/2048 *	1.710	4,04
EUR 1.296	Landmark Mortgage Securities Nr. 2 Sps 2, Klasse BC, 0,282 %, due 6/17/2039 *	1.293	3,05
1.660	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust LDP 12. Series 2013 C7. Klasse C 4,261 %, due 2/15/2046 *	1.723	4,07
1.045	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust LDP 12. Series 2013 C9. Klasse 144A, 4,261 %, due 5/15/2046 *	1.065	2,51
830	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust LDP 12. Series 2015 C27. Klasse AS, 4,068 %, due 12/15/2047	906	2,14
413	Neue Wohnhypothek Loan Trust 2018-NQM1, Serie Series 2018 NQM1, Class A1, 144A, 3,986 %, due 11/25/2048 *	422	1,00
EUR 712	RMAC Securities No 1 Plc, Series 2006 NS1X, Class B1C, 144A, 0,562 %, due 6/12/2044 *	732	1,73
490	Sequoia Mortgage Trust LDP 12. Series 2018 CH1. Klasse A1, 144A, 4,000 %, due 2/25/2048 *	509	1,20
EUR 23	TDA 24 FTA 24, KLASSE A1, 0,000 %, due 6/22/2040 *	26	0,06
EUR 1.300	TDA 27 FTA 27, KLASSE A3, 0,000 %, due 12/28/2050 *	1.263	2,99
1.703	Wells Fargo Re-REMIC Trust FRR 1. Series 2013 FRR 1. Klasse BK20, 144A, 0,000 %, due 5/27/2045	1.533	3,62
614	WFRBS Commercial Mortgage Vertrauen 2013-C11, Serie 2013 OPT 1. Class 144A. 4,404 %, due 3/15/2045 *	630	1,49
Hypothekarisch besicherte Wertpapiere insgesamt (Anschaffungskosten USD 29.972)		31.107	73,48
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 4,52 % (28. Februar 2019 5,96 %)			
Brasilien – 1,17 % (28. Februar 2019: 1,11 %)			
470	Vale Overseas Ltd, 5,875 %, due 6/10/2021	498	1,17
USA – 3,35 % (28. Februar 2019: 4,85 %)			
124	Chesapeake Energy Corp, 5,000 % 6,125 %, due 2/15/2021	117	0,28
1.205	Sprint Corp, 7,250 %, due 9/15/2021	1.299	3,07
		1.416	3,35
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 1.857)		1.914	4,52
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 6,30 % (28. Februar 2019 0,00 %)			
USA – 6,30 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
570	Us-Schatzamt Floating Rate Note, 2,075 %, due 1/31/2021 *	569	1,35
1.740	United States Treasury Note/ Bond, Anleihe, 2,875 %, due 5/15/2049	2.096	4,95
		2.665	6,30
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 2.614)		2.665	6,30
Schuldscheindarlehen – 1,18 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
500	Select Medical Holdings Corp 4,850 %, due 3/6/2025 *	499	1,18
Darlehensnotizen Gesamt (Anschaffungskosten USD 498)		499	1,18
Investmentfonds - 1,91 % (28. Februar 2019 7,07 %)			
808	Goldman Sachs London Liquid Reserves Fund - Institutionelle Klasse	808	1,91
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 808)		808	1,91
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 39.465)		40.795	96,37
Credit Default Swaps – 0,53 % (28. Februar 2019 0,18 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		225	0,53
Devisenterminkontrakte – 0,84 % (28. Februar 2019 0,50 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		357	0,84
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		41.377	97,74
Credit Default Swaps – (1,33 %) (28. Februar 2019 0,07 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(563)	(1,33)
Devisenterminkontrakte – (1,25 %) (28. Februar 2019 0,50 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(532)	(1,25)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		(1.095)	(2,58)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten		40.282	95,16
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		2.051	4,84
Nettovermögen insgesamt		USD 42.333	100,00

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

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf 66.000 USD und machten 30,01 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

EUR – Euro

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,03
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen gehandelt werden Regulierter Markt	1,14
Investmentfonds	1,84
Derivate	1,33
Sonstige Vermögenswerte	5,66
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^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kauf/Verkauf Schutz	Ablauf Datum	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Barclays	GT Corp, 5,000 %	Verkauf	20.6.22	731	USD 73
Barclays	Riginc Corp, 1,000 %	Verkauf	20.6.21	420	(17)
Barclays	Rite Aid Corporation, 5,000 %	Verkauf	20.6.20	285	(15)
Barclays	Rite Aid Corporation, 5,000 %	Verkauf	20.6.20	135	(7)
Barclays	Sprint Communications Inc	Verkauf	20.6.21	795	61
Barclays	T-Mobile USA Inc, 5,000 %	Verkauf	20.6.22	725	88
Citi	CDX.NA.IG, 1,000 %	Kauf	20.6.24	16.665	(352)
Citi	Chesapeake Energy Corp, 5,000 %	Verkauf	20.12.21	1.005	(83)
JP Morgan	CMBX.NA.AAA, 0,500 %	Kauf	18.11.54	1.730	(6)
Morgan Stanley	Chesapeake Energy Corp, 5,000 %	Verkauf	20.12.21	805	(67)
Morgan Stanley	CMBX.NA.AAA, 0,500 %	Kauf	18.11.54	1.415	(5)
Morgan Stanley	CMBX.NA.AAA, 0,500 %	Kauf	18.11.54	1.175	(4)
Morgan Stanley	CMBX.NA.AAA, 0,500 %	Kauf	18.11.54	1.175	(4)
Morgan Stanley	Dell Inc., 1,000 %	Verkauf	20.12.22	925	(3)
Morgan Stanley	Dell Inc., 1,000 %	Verkauf	20.6.22	520	3
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 79)					USD 225
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (29))					(563)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 50					USD (338)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.596	Verkauf	BRL	10.717	USD 8
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	BRL	10.717	Verkauf	USD	2.830	(242)
12.09.19	Barclays	Kauf	USD	4.642	Verkauf	EUR	4.090	143
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	325	Verkauf	USD	397	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	5	Verkauf	USD	5	-
12.09.19	Citi	Kauf	EUR	1.630	Verkauf	USD	1.845	(52)
12.09.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	776	Verkauf	EUR	700	7
12.09.19	HSBC	Kauf	USD	992	Verkauf	EUR	888	15
12.09.19	JP Morgan	Kauf	USD	5.609	Verkauf	EUR	4.980	132
12.09.19	JP Morgan	Kauf	EUR	2.840	Verkauf	USD	3.213	(89)
12.09.19	UBS	Kauf	EUR	1.690	Verkauf	USD	1.882	(23)
20.09.19	Citi	Kauf	USD	471	Verkauf	GBP	370	20
20.09.19	Goldman Sachs	Kauf	USD	421	Verkauf	GBP	330	19
20.09.19	HSBC	Kauf	GBP	700	Verkauf	USD	892	(40)
27.09.19	Citi	Kauf	JPY	112.800	Verkauf	USD	1.068	(4)
27.09.19	HSBC	Kauf	USD	4.201	Verkauf	JPY	445.000	4
27.09.19	HSBC	Kauf	JPY	112.000	Verkauf	USD	1.064	(8)
27.09.19	UBS	Kauf	JPY	220.200	Verkauf	USD	2.100	(23)
01.10.19	BNY Mellon	Kauf	BRL	10.855	Verkauf	USD	2.624	(8)
22.10.19	HSBC	Kauf	USD	4.252	Verkauf	KRW	5.180.000	(35)
22.10.19	HSBC	Kauf	KRW	5.180.000	Verkauf	USD	4.277	8
08.10.19	HSBC	Kauf	USD	852	Verkauf	PHP	45.000	(8)
08.10.19	HSBC	Kauf	PHP	45.000	Verkauf	USD	859	1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 220)								357
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (221))								(532)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (1))								USD (175)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 95,07 % (28. Februar 2019 77,38 %)			
Brasilien – 1,92 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
200	BRF SA 3,950 %, due 5/22/2023	200	1,92
Kanada – 1,34 % (28. Februar 2019: 1,27 %)			
130	Air Canada, 144A, 7,750 %, due 4/15/2021	140	1,34
Ghana – 1,92 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
200	Tullow Oil Plc, 144A, 6,250 %, due 4/15/2022	200	1,92
Irland – 1,97 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
200	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,625 %, due 5/15/2023	205	1,97
Mexiko – 1,10 % (28. Februar 2019: 0,99 %)			
120	Petroleos Mexicanos, 4,250 %, due 1/15/2025	115	1,10
Großbritannien – 2,57 % (28. Februar 2019: 2,33 %)			
250	FIAT Chrysler Automobiles NV, 5,250 %, due 4/15/2023	268	2,57
USA – 81,99 % (28. Februar 2019: 71,77 %)			
140	AES Corp/VA 4,000 %, due 3/15/2021	143	1,38
145	AK Stahlkorp, 7,500 %, due 7/15/2023	147	1,41
175	Orasure Technologies Inc 5,950 %, due 1/15/2021	180	1,73
95	Ally Financial Inc 4,625 %, due 5/19/2022	101	0,96
300	AmeriGas Partners LP/AmeriGas Finanzabteilung, 5,625 %, due 5/20/2024	320	3,07
150	Targa Resources Corp 5,375 %, due 11/1/2021	146	1,40
100	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,500 %, due 3/15/2022	104	0,99
95	Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, due 3/15/2024	101	0,97
150	Boise Cascade Co, 144A, 5,625 %, due 9/1/2024	156	1,50
115	GSI Group Inc 4,125 %, due 3/9/2021	118	1,13
100	GSI Group Inc 5,000 %, due 8/1/2023	109	1,04
120	Clearway Energy Operating LLC, 5,000 %, due 9/15/2026	122	1,17
140	Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 5,875 %, due 6/1/2027	137	1,31
36	CommScope Inc., 5,000 %, due 6/15/2021	36	0,35
50	CommScope Inc, 144A, 6,000 %, due 3/1/2026	51	0,49
150	CSC Holdings LLC, 5,250 %, due 6/1/2024	161	1,54
150	CyrussOne LP/CyrusOne-Finanzen Corp., 5,000 %, due 3/15/2024	155	1,49
240	DaVita Inc, 5,000 %, due 5/1/2025	241	2,32
95	Dell International LLC/EMC Corp, 144A 7,125 %, due 6/15/2024	100	0,96
100	Dell International LLC/EMC Corp, 144A 6,020 %, due 6/15/2026	113	1,08
125	Gericht DBS Corp, 5,000 %, due 3/15/2023	123	1,18
50	Edgewell Personal Care Co, 4,700 %, due 5/19/2021	51	0,49
215	CRC Health Corp 5,750 %, due 11/1/2024	219	2,10
120	Energieübertragung Betrieb LP, 5,500 %, due 6/1/2027	138	1,33
210	Equinix Inc 5,375 %, due 4/1/2023	215	2,06
100	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc., 5,375 %, due 4/15/2026	110	1,06
225	Grauer Fernseher, Inc, 144A, 5,125 %, due 10/15/2024	233	2,24
100	Hughes Satellite Systems Corp, 5,250 %, due 8/1/2026	106	1,02
105	Icahn Enterprises LP/Icahn Unternehmen Finance Corp, 144A, 6,250 %, due 5/15/2026	110	1,05
120	Iron Mountain Inc, 144A, 5,250 %, due 3/15/2028	125	1,20
165	Koppers Inc, 144A, 6,000 %, due 2/15/2025	161	1,55
180	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, due 2/1/2030	191	1,84
35	Navios Maritime Acquisition Corp / Navios Acquisition Finance US Inc., 144A 8,125 %, due 11/15/2021	29	0,27
100	CVR Energy Inc 6,625 %, due 1/15/2027	108	1,04
200	Perrigo Finance Unlimited Co, 3,900 %, due 12/15/2024	205	1,97
315	PetSmart Inc, 144A, 5,875 %, due 6/1/2025	310	2,98
105	Pitney Bowes Inc., 3,875 %, due 10/1/2021	105	1,01
110	Qorvo Inc., 5,500 %, due 7/15/2026	118	1,13
160	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 5,250 %, due 12/1/2021	156	1,50
115	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 9,375 %, due 4/1/2027	100	0,96
215	Reynolds Group Emittent Inc/Reynolds Group Emittent LLC / Reynolds Group Aussteller Lu, 144A, 5,125 %, due 7/15/2023	222	2,13
110	Frontier Communications Corp, 4,875 %, due 7/15/2022	112	1,08
25	Wählen Sie Medical Corp, 144A, 6,250 %, due 8/15/2026	26	0,25
25	Service Corp International/USA, 5,125 %, due 6/1/2029	27	0,26
200	Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,625 %, due 8/1/2024	207	1,98
275	Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,875 %, due 3/15/2026	289	2,78
200	SIRIUS XM Radio Inc, 5,375 %, due 7/15/2026	212	2,03
280	Ares Capital Corp 6,875 %, due 11/15/2028	311	2,99
250	Sprint Corp, 7,250 %, due 9/15/2021	270	2,59
200	Steel Dynamics Inc 5,125 %, due 10/1/2021	201	1,93
136	Symantec Corp, 144A, 5,000 %, due 4/15/2025	137	1,32
100	Tenet Healthcare Corp, 4,500 %, due 4/1/2021	104	0,99
240	Tenet Healthcare Corp, 4,375 %, due 10/1/2021	250	2,40
102	Transocean Guardian Ltd, 144A, 5,875 %, due 1/15/2024	104	1,00
160	Univision Communications Inc 144A 5,125 %, due 5/15/2023	159	1,52
95	Viasat Inc, 144A, 5,625 %, due 4/15/2027	101	0,97
150	WR Grace & Co-Conn, 144A, 5,125 %, due 10/1/2021	156	1,50
		8.542	81,99
Sambia – 2,26 % (28. February 2019: 1,02 %)			
30	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,000 %, due 2/15/2021	30	0,29
210	First Quantum Minerals Ltd, 7,250 %, due 5/15/2022	205	1,97
		235	2,26
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 9.688)		9.905	95,07
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 2,96 % (28. Februar 2019 0,00 %)			
Türkei – 2,96 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
400	Türkei Government International Anleihe, 4,875 %, due 4/16/2043	308	2,96
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 312)		308	2,96
Schuldscheindarlehen – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
-	PetSmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022 *	1	-
Loan Notes insgesamt (Anschaffungskosten USD 1)		1	-
Investmentfonds – 0,21 % (28. Februar 2019 2,97 %)			
21	Goldman Sachs Flüssigkeit in USD Reservefonds - Institutional Class	21	0,21
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 21)		21	0,21
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 10.022)		10.235	98,24
Credit Default Swaps – 2,27 % (28. Februar 2019 1,16 %)			
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	237	2,27
Devisenterminkontrakte – 0,34 % (28. Februar 2019 0,33 %)			
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	35	0,34
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		10.507	100,86
Credit Default Swaps – 0,00 % (28. Februar 2019 0,06 %)			
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-	-
Devisenterminkontrakte – (2,45 %) (28. Februar 2019 0,40 %)			
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(255)	(2,45)
Futures – (0,03 %) (28. Februar 2019: 0,00 %)			
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(3)	(0,03)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(258)	(2,49)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verlust		10.249	98,37
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		169	1,63
Nettovermögen insgesamt	USD	10.418	100,00

- Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Registrierung befreite Wertpapiere gemäß Regel 144A von Das Securities Act von 1933 in der geänderten Fassung. Diese Wertpapiere dürfen nur weiterverkauft werden, bei Transaktionen ausgenommen Von der Registrierung bis hin zu qualifizierten institutionellen Käufern. Zum 31. August 2019 betrugen diese Wertpapiere USD 3.962.000 und machten 38,02 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,47
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen gehandelt werden Regulierter Markt	-
Investmentfonds	0,19
Derivate	2,50
Sonstige Vermögenswerte	3,84
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^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenz	Kauf/Verkauf Schutz	Ende der Laufzeit	Nomineller Betrag (in Tsd.)	wert (in Tsd.)
Barclays	CCO Holdings LLC, 5,000 %	Verkauf	20.6.21	95	USD 8
Barclays	Sprint Communications Inc	Verkauf	20.6.21	195	15
Barclays	T-Mobile USA Inc, 5,000 %	Verkauf	20.6.22	130	16
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 %	Verkauf	20.6.24	985	66
Citi	Markit iTraxx Europe, 5,000 %	Verkauf	20.6.24	855	104
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 % due 3/1/2021	Verkauf	20.6.22	185	18
JP Morgan	AK Steel Corporation, 5,000 %	Verkauf	20.6.20	100	3
JP Morgan	United States Steel Corp, 5,000 %	Verkauf	20.6.21	95	6
Morgan Stanley	Dell Inc., 1,000 %	Verkauf	20.12.22	205	-
Morgan Stanley	Dell Inc., 1,000 %	Verkauf	20.6.22	165	1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 127)					USD 237
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (7))					-
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 120)					USD 237

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
12.09.19	Barclays	Kauf	USD	885	Verkauf	EUR	780	USD 27
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	34	Verkauf	CAD	50	(1)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	181	Verkauf	GBP	167	(4)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	7.591	Verkauf	USD	8.535	(186)
12.09.19	Citi	Kauf	USD	712	Verkauf	EUR	640	8
12.09.19	Citi	Kauf	EUR	940	Verkauf	USD	1.065	(31)
12.09.19	Goldman Sachs	Kauf	EUR	210	Verkauf	USD	234	(3)
12.09.19	JP Morgan	Kauf	EUR	460	Verkauf	USD	526	(20)
12.09.19	UBS	Kauf	EUR	280	Verkauf	USD	315	(7)
20.09.19	HSBC	Kauf	GBP	170	Verkauf	USD	208	(1)
27.11.19	HSBC	Kauf	EGP	10.700	Verkauf	USD	632	(2)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 36)								35
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (44))								(255)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (8))								USD (220)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. Long Bond (CBT) March 2019	5	USD 826	USD (1)
U.S. Ultra Bond (CBT) March 2019	1	198	(2)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)			USD -
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)			(3)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)			USD (3)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Nennwert (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 4,46 % (28. Februar 2019 4,63 %)			
USA – 4,46 % (28. Februar 2019: 4,63 %)			
3.725	American Express Co 2,887 %, due 11/5/2021 *	3.746	1,01
6.805	Caterpillar Financial Servicekorb, 2,640 %, due 3/15/2021 *	6.809	1,84
5.980	Ford Motor Co LLC, 3,099 %, due 4/5/2021 *	5.936	1,61
		16.491	4,46
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Anschaffungskosten USD 16.480)		16.491	4,46
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 89,38 % (28. Februar 2019 86,82 %)			
Argentinien – 3,76 % (28. Februar 2019: 4,91 %)			
ARS 319.000	Staatsanleihen In Argentinien BONCER, 2,500 %, due 7/22/2021 β	3.901	1,06
26.300	Argentinische Republik Government International Anleihe, 5,875 %, due 1/11/2028	9.994	2,70
		13.895	3,76
Australien – 2,06 % (28. Februar 2019: 1,85 %)			
AUD 11.300	Australische Regierung Bond, Serie 143, 2,750 %, due 10/21/2019	7.628	2,06
Brasilien – 9,77 % (28. Februar 2019: 8,91 %)			
BRL 130.375	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series Ob, 10,000 %, due 1/1/2027	36.107	9,77
Kolumbien – 4,83 % (28. Februar 2019: 4,67 %)			
COP 61.020.000	Kolumbianische TES, Serie B, 6,000 %, due 4/28/2028	17.860	4,83
Indonesien – 9,76 % (28. Februar 2019: 8,54 %)			
IDR 465.700.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR71, 9,000 %, due 3/15/2029	36.081	9,76
Malaysia – 6,23 % (28. Februar 2019: 5,53 %)			
MYR 17.750	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0315, 3,659 %, due 10/15/2020	4.248	1,15
MYR 41.800	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0117, 3,882 %, due 3/10/2022	10.117	2,74
MYR 12.225	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0313, 3,480 %, due 3/15/2023	2.935	0,79
MYR 7.475	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0115, 3,955 %, due 9/15/2025	1.843	0,50
MYR 15.790	Regierung Von Malaysia Bond, Serie 0417, 3,899 %, due 11/16/2027	3.902	1,05
		23.045	6,23
Mexiko – 22,27 % (28. Februar 2019: 21,21 %)			
MXN 211.000	Mexikanische Bonos, Serie M 20, 8,500 %, due 5/31/2029	11.647	3,15
MXN 204.000	Mexikanische Bonos, Serie M 30, 8,500 %, due 11/18/2038	11.306	3,06
MXN 850.000	Mexican Bonos, Series M 20, 7,750 %, due 11/13/2042	43.759	11,83
MXN 295.700	Mexican Bonos, Series M 20, 8,000 %, due 11/7/2047	15.649	4,23
		82.361	22,27
Südafrika – 11,41 % (28. Februar 2019: 11,41 %)			
ZAR 161.800	Republik Südafrika Staatsanleihen, Serie R214, 6,500 %, due 2/28/2041	7.499	2,03
ZAR 594.065	Republik Südafrika Staatsanleihen, Serie 2048, 8,750 %, due 2/28/2048	34.703	9,38
		42.202	11,41
USA – 19,29 % (28. Februar 2019: 14,42 %)			
71.410	US-Dollar Hinweis Zur Gleitrate, 2,099 %, due 4/30/2021 *	71.331	19,29
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten USD 335.758)		330.510	89,38
Investmentfonds – 4,43 % (28. Februar 2019 4,63 %)			
5.452	Goldman Sachs London Liquid Reserves Fund - Institutionelle Klasse	5.452	1,47
88	Legg Mason Investments Funds Plc - Brandywine Globale Gutschrift Opportunities Fund* Klasse GP USD thesaurierend	10.942	2,96
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 15.762)		16.394	4,43
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 368.000)		363.395	98,27
Devisenterminkontrakte – 0,90 % (28. Februar 2019 1,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		3.313	0,90
Futures – 1,87 % (28. Februar 2019: 0,26 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		6.925	1,87
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		373.633	101,04
Devisenterminkontrakte – (3,93 %) (28. Februar 2019 0,79 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(14.536)	(3,93)
Futures – (2,19 %) (28. Februar 2019: 1,01 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(8.095)	(2,19)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(22.631)	(6,12)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verlust		351.002	94,92
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		18.779	5,08
Nettovermögen insgesamt	USD	369.781	100,00

- Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

β Der Zinssatz für diese Art von Sicherheit ist an den gebunden Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI). Die Der Couponsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2019.

ABKÜRZUNGEN:

ARS – Argentinischer Peso
AUD – Australischer Dollar
BRL – Brasilianischer Real
COP – Kolumbianischer Peso
IDR – Indonesische Rupiah
MXN – Mexikanischer Peso
MYR – Malaysischer Ringgit
ZAR – Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,05
Investmentfonds	4,07
Derivate	2,54
Sonstige Vermögenswerte	7,34
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
11.09.19	Barclays	Kauf	USD	19.611	Verkauf	ZAR	295.100	USD 179
11.09.19	HSBC	Kauf	USD	8.161	Verkauf	ZAR	119.500	292
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	13.092	Verkauf	AUD	19.318	78
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	EUR	-	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	GBP	-	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.807	Verkauf	SGD	3.900	(3)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	8	Verkauf	USD	10	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	469.587	Verkauf	USD	318.846	(2.505)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	9	Verkauf	USD	10	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	95.189	Verkauf	USD	68.991	(390)
12.09.19	Citi	Kauf	USD	3.728	Verkauf	EUR	3.350	43
12.09.19	JP Morgan	Kauf	USD	17.548	Verkauf	EUR	15.580	412
12.09.19	HSBC	Kauf	USD	847	Verkauf	CLP	600.000	15
12.09.19	HSBC	Kauf	CLP	8.050.000	Verkauf	USD	11.676	(519)
17.09.19	Citi	Kauf	USD	1.213	Verkauf	SEK	11.700	20
17.09.19	Citi	Kauf	SEK	118.400	Verkauf	USD	12.510	(434)
17.09.19	HSBC	Kauf	USD	12.270	Verkauf	SEK	115.600	479

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
17.09.19	HSBC	Kauf	SEK	431.200	Verkauf	USD	45.986	USD (2.007)
20.09.19	Citi	Kauf	GBP	3.030	Verkauf	USD	3.726	(36)
25.09.19	HSBC	Kauf	NZD	12.850	Verkauf	USD	8.554	(452)
25.09.19	JP Morgan	Kauf	NZD	64.670	Verkauf	USD	42.887	(2.111)
26.09.19	Citi	Kauf	USD	513	Verkauf	CZK	11.900	9
26.09.19	JP Morgan	Kauf	CZK	381.100	Verkauf	USD	17.048	(899)
27.09.19	Citi	Kauf	KRW	19.573.000	Verkauf	USD	17.012	(833)
27.09.19	HSBC	Kauf	USD	46.429	Verkauf	JPY	4.920.000	30
09.10.19	Barclays	Kauf	MXN	23.100	Verkauf	USD	1.171	(26)
09.10.19	HSBC	Kauf	USD	42.493	Verkauf	MXN	825.300	1.577
10.10.19	Barclays	Kauf	MYR	141.300	Verkauf	USD	34.182	(737)
18.10.19	HSBC	Kauf	SEK	42.300	Verkauf	USD	4.536	(213)
24.10.19	HSBC	Kauf	GBP	34.100	Verkauf	USD	42.674	(1.089)
24.10.19	National Australia Bank Ltd	Kauf	USD	1.060	Verkauf	GBP	870	(1)
29.10.19	HSBC	Kauf	CLP	7.030.000	Verkauf	USD	10.259	(511)
08.11.19	Citi	Kauf	RUB	1.927.000	Verkauf	USD	29.221	(600)
13.11.19	Citi	Kauf	USD	41.736	Verkauf	SGD	57.620	179
13.11.19	Citi	Kauf	SGD	1.270	Verkauf	USD	918	(2)
13.11.19	HSBC	Kauf	CLP	7.480.000	Verkauf	USD	10.508	(133)
15.11.19	HSBC	Kauf	USD	15.277	Verkauf	ZAR	238.560	(301)
22.11.19	Morgan Stanley	Kauf	AUD	35.220	Verkauf	USD	23.960	(185)
05.12.19	HSBC	Kauf	NZD	10.180	Verkauf	USD	6.511	(81)
06.12.19	Goldman Sachs	Kauf	NOK	232.700	Verkauf	USD	26.048	(468)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 3.555)								3.313
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (2.766))								(14.536)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 789)								USD(11.223)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nomineller wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day EuroUSD December 2020	(3.354)	USD(827.935)	USD (3.837)
Euro-BTP September 2019	949	151.558	6.702
Euro-Buxl 30 Jahre Bond Dezember 2019	(264)	(64.604)	223
Euro-OAT September 2019	(532)	(99.632)	(4.070)
Long Gilt June 2019	(273)	(44.606)	(188)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 924)			USD 6.925
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (3.582))			(8.095)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (2.658))			USD (1.170)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettovermögenswert
Investmentfonds – 1,31 % (28. Februar 2019 0,79 %)			
44	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund Fonds - Institutional Class	44	1,31
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 44)		44	1,31
Stammaktien – 99,09 % (28. Februar 2019: 99,17 %)			
Werbung – 1,08 % (28. Februar 2019: 0,56 %)			
–	Web.Com Group Inc	36	1,08
Luft– und Raumfahrt und Verteidigung – 0,46 % (28. Februar 2019 0,74 %)			
–	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	15	0,46
Landwirtschaft – 2,21 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
2	Altria Group Inc	74	2,21
Fluggesellschaften – 2,72 % (28. Februar 2019: 1,28 %)			
1	Delta Air Lines Inc	68	2,03
–	Southwest Airlines Co	23	0,69
		91	2,72
Bekleidung – 0,13 % (28. Februar 2019: 0,17 %)			
–	Carter's Inc	3	0,08
–	Ralph Lauren Corp	1	0,05
		4	0,13
Verschiedene verarbeitende Gewerbe – 0,17 % (28. Februar 2019 0,00 %)			
–	PACCAR Inc	6	0,17
Kfz–Teile und Zubehör – 0,25 % (28. Februar 2019 0,51 %)			
–	Allison Transmission Holdings Inc	8	0,25
Banken – 9,05 % (28. Februar 2019: 14,69 %)			
4	Bank of America Corp	103	3,09
–	GSI Group Inc	7	0,20
–	Comerica Inc	19	0,56
–	Huntington Bancshares Inc/OH	5	0,16
–	M&T Bank Corp	24	0,74
–	Popular Inc	7	0,20
3	Wells Fargo & Co	126	3,79
–	Zions Bancorp NA	10	0,31
		301	9,05
Getränke – 0,66 % (28. Februar 2019: 0,55 %)			
–	Brown-Forman Corp	22	0,66
Biotechnologie – 6,08 % (28. Februar 2019: 4,52 %)			
1	Amgen Inc	145	4,35
–	Biogen Inc	57	1,73
		202	6,08
Baustoffe – 0,14 % (28. Februar 2019: 0,04 %)			
–	Armstrong World Industries Inc	5	0,14
Chemie – 2,63 % (28. Februar 2019: 1,11 %)			
–	Albemarle Corp	6	0,17
–	Celanese Corp 'A'	27	0,80
–	Newmarket Corp	7	0,21
–	PPG Industries Inc	48	1,45
		88	2,63
Gewerbliche Dienstleistungen – 0,54 % (28. Februar 2019 0,44 %)			
–	ManpowerGroup Inc	5	0,15
–	Robert Half International Inc	10	0,30
–	United Rentals Inc	3	0,09
		18	0,54
Computer – 6,22 % (28. Februar 2019: 5,25 %)			
1	Apple Inc	133	3,99
–	International Business Machines Corp	60	1,82
–	NetApp Inc	14	0,41
		207	6,22
Kosmetika & Körperpflege – 1,11 % (28. Februar 2019 0,00 %)			
–	Procter & Gamble Co	37	1,11
Distribution und Großhandel – 0,20 % (28. Februar 2019 0,82 %)			
–	HD Supply Holdings Inc	6	0,20
Diversifiziert – Finanzdienstleistungen – 4,14 % (28. Februar 2019 4,35 %)			
1	Discover Financial Services	62	1,85
–	Regions Financial Corp	15	0,46
–	Eaton Vance Corp	2	0,05
–	LPL Financial Holdings Inc	10	0,31
1	Synchrony Financial	40	1,20
–	TD Ameritrade Holding Corp	9	0,27
		138	4,14
Elektrik – 2,66 % (28. Februar 2019: 1,12 %)			
–	AES Corp/VA	4	0,11
–	American Electric Power Co Inc	16	0,47
–	Gibson Energy Inc	17	0,52
–	Duke Energy Corp	16	0,50
–	Exelon Corp	9	0,28
–	NextEra Energy Inc	26	0,78
		88	2,66
Elektronik – 1,55 % (28. Februar 2019: 0,20 %)			
1	Gentex Corp	15	0,45
–	Honeywell International Inc	31	0,92
–	Sensata Technologies Holding Plc	6	0,18
		52	1,55
Unterhaltung – 0,06 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
–	Churchill Downs Inc	2	0,06
Umweltkontrolle – 0,26 % (28. Februar 2019 0,20 %)			
–	Pentair Plc	9	0,26
Lebensmittel – 0,14 % (28. Februar 2019: 0,93 %)			
–	Ingredion Inc	5	0,14
Hand– und Maschinenwerkzeuge – 0,48 % (28. Februar 2019 0,00 %)			
–	Lincoln Electric Holdings Inc	6	0,18
–	Snap-on Inc	10	0,30
		16	0,48
Medizinische Produkte – 2,40 % (28. Februar 2019 2,00 %)			
1	Baxter International Inc	80	2,40
Medizinische Dienstleistungen – 0,19 % (28. Februar 2019: 1,18 %)			
–	DaVita Inc	6	0,19
Wohnungsbauunternehmen – 0,06 % (28. Februar 2019: 0,27 %)			
–	Toll Brothers Inc	2	0,06
Versicherungen – 0,22 % (28. Februar 2019: 4,02 %)			
–	Lincoln National Corp	7	0,22
Internet – 6,31 % (28. Februar 2019: 1,65 %)			
–	WINDSTREAM HOLDINGS INC	112	3,36
–	AES Corp/VA	22	0,65
2	eBay Inc	76	2,30
		210	6,31
Eisen/Stahl – 0,86 % (28. Februar 2019: 0,46 %)			
1	Nucor Corp	28	0,86
Freizeit – 0,67 % (28. Februar 2019: 0,08 %)			
–	Carnival Corp	9	0,27
–	Harley-Davidson Inc	9	0,28
–	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	4	0,12
		22	0,67
Unterkunft – 1,57 % (28. Februar 2019: 2,50 %)			
–	Marriott International Inc/MD	52	1,57
Maschinenbau – Bau und Bergbau – 2,30 % (28. Februar 2019 0,60 %)			
1	Caterpillar Inc	75	2,25
–	Oshkosh Corp	1	0,05
		76	2,30
Maschinenanlagen – diversifiziert – 2,00 % (28. Februar 2019 0,77 %)			
–	Cummins Inc	32	0,96
–	Dover Corp	16	0,46
–	Brooks Automation Inc	19	0,58
		67	2,00
Verschiedene verarbeitende Gewerbe – 6,27 % (28. Februar 2019 2,21 %)			
1	3M Co	85	2,55
–	Hexcel Corp	6	0,18
1	Illinois Tool Works Inc	84	2,53
–	Parker-Hannifin Corp	17	0,51
–	Textron Inc	17	0,50
		209	6,27
Öl und Gas – 2,92 % (28. Februar 2019: 7,37 %)			
1	Kodiak Oil & Gas Corp	9	0,27
–	Chevron Corp	33	1,00
–	ConocoPhillips	21	0,64
–	Exxon Mobil Corp	34	1,01
		97	2,92
Pharmaindustrie – 2,88 % (28. Februar 2019: 2,94 %)			
–	AmerisourceBergen Corp	22	0,65
–	Johnson & Johnson	16	0,48
2	Pfizer Inc	58	1,75
		96	2,88
Einzelhandel – 9,09 % (28. Februar 2019: 13,17 %)			
1	Best Buy Co Inc	39	1,16
–	CarMax Inc	18	0,53
–	FirstCash Inc	4	0,12
–	Foot Locker Inc	6	0,19
–	O'Reilly Automotive Inc	30	0,90
1	Target Corp	107	3,21
2	Walgreens Boots Alliance Inc	88	2,64
–	Williams-Sonoma Inc	11	0,34
		303	9,09
Halbleiter – 6,91 % (28. Februar 2019: 6,94 %)			
3	Intel Corp	134	4,03
–	Lam Research Corp	19	0,57
–	Maxim Integrated Products Inc	7	0,21
–	Teradyne Inc	11	0,34
–	Texas Instruments Inc	59	1,76
		230	6,91
Schiffbau – 0,26 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
–	Huntington Ingalls Industries Inc	9	0,26
Software – 2,46 % (28. Februar 2019: 3,60 %)			
2	Oracle Corp	82	2,46
Telekommunikation – 3,62 % (28. Februar 2019 5,50 %)			
2	Cisco Systems Inc	86	2,57
–	Ubiquiti Inc	8	0,23
–	Verizon Communications Inc	27	0,82
		121	3,62
Transportwesen – 5,16 % (28. Februar 2019: 5,81 %)			
1	CSX Corp	44	1,31
–	Norfolk Southern Corp	37	1,10
1	Union Pacific Corp	91	2,75
		172	5,16
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 3.219)		3.299	99,09
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 3.263)		3.343	100,40
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		3.343	100,40
Devisenterminkontrakte – (0,59 %) (28. Februar 2019 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(20)	(0,59)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(20)	(0,59)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verlust		3.323	99,81
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		7	0,19
Nettovermögen insgesamt		USD 3.330	100,00

- Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^*

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,72
Investmentfonds	1,30
Sonstige Vermögenswerte	0,98
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)				Verkauf Währung (in Tsd.)				Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
09.12.19	BNY Mellon	Kauf		EUR	841	Verkauf		USD	944		USD	(20)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 6)												-
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)												(20)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 6)											USD	(20)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Value Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Stammaktien – 90,57 % (28. Februar 2019: 96,16 %)			
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung – 0,71 % (28. Februar 2019: 0,67 %)			
EUR 17	Safran SA	2.432	0,71
Landwirtschaft – 1,28 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
100	Altria Group Inc	4.391	1,28
Fluggesellschaften – 2,19 % (28. Februar 2019: 1,78 %)			
130	Delta Air Lines Inc	7.511	2,19
Bekleidung – 0,83 % (28. Februar 2019: 0,83 %)			
107	Capri Holdings Ltd	2.835	0,83
Automobilhersteller – 1,30 % (28. Februar 2019: 1,39 %)			
121	General Motors Co	4.470	1,30
Banken – 6,61 % (28. Februar 2019: 6,57 %)			
132	Citigroup Inc	8.506	2,48
184	KeyCorp	3.053	0,89
239	Wells Fargo & Co	11.137	3,24
		22.696	6,61
Getränke – 2,20 % (28. Februar 2019: 1,55 %)			
80	Anheuser-Busch InBev SA/NV ADR	7.556	2,20
Biotechnologie – 2,56 % (28. Februar 2019: 5,08 %)			
76	Alexion Pharmaceuticals Inc	7.631	2,22
39	Corteva Inc	1.147	0,34
		8.778	2,56
Baustoffe – 0,81 % (28. Februar 2019: 0,99 %)			
49	Owens Corning	2.785	0,81
Computer – 4,37 % (28. Februar 2019: 3,26 %)			
118	DXC Technology Co	3.907	1,14
54	International Business Machines Corp	7.330	2,13
79	NetApp Inc	3.779	1,10
		15.016	4,37
Diversifiziert – Finanzdienstleistungen – 5,82 % (28. Februar 2019: 5,35 %)			
103	Intercontinental Exchange Inc	9.587	2,79
325	Synchrony Financial	10.401	3,03
		19.988	5,82
Elektrik – 4,13 % (28. Februar 2019: 5,05 %)			
395	AES Corp/VA	6.064	1,76
172	Exelon Corp	8.128	2,37
		14.192	4,13
Lebensmittel – 3,54 % (28. Februar 2019: 2,82 %)			
134	Conagra Brands Inc	3.807	1,11
151	Mondelez International Inc	8.354	2,43
		12.161	3,54

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Wohnungsbauunternehmen – 1,36 % (28. Februar 2019: 1,20 %)			
91	Lennar Corp	4.654	1,36
Versicherungen – 7,83 % (28. Februar 2019: 8,12 %)			
286	American International Group Inc	14.852	4,33
114	AXA Equitable Holdings Inc	2.377	0,69
66	Brighthouse Financial Inc	2.330	0,68
57	MetLife Inc	2.518	0,73
97	Voya Financial Inc	4.808	1,40
		26.885	7,83
Internet – 6,87 % (28. Februar 2019: 7,06 %)			
16	Alphabet Inc	19.590	5,70
22	Facebook Inc 'A'	4.000	1,17
		23.590	6,87
Maschinenanlagen – diversifiziert – 0,68 % (28. Februar 2019: 0,81 %)			
EUR 49	KION Group AG	2.342	0,68
Bergbau – 4,22 % (28. Februar 2019: 2,65 %)			
109	Royal Gold Inc	14.485	4,22
Öl und Gas – 3,10 % (28. Februar 2019: 4,15 %)			
180	Devon Energy Corp	3.964	1,15
666	Encana Corp	2.953	0,86
30	Pioneer Natural Resources Co	3.726	1,09
		10.643	3,10
Öl- und Gasdienstleistungen – 0,62 % (28. Februar 2019: 1,02 %)			
114	Halliburton Co	2.138	0,62
Pharmaindustrie – 9,40 % (28. Februar 2019: 8,95 %)			
95	Allergan Plc	15.105	4,40
143	Bristol-Myers Squibb Co	6.851	1,99
72	CVS Health Corp	4.386	1,28
305	Mylan NV	5.935	1,73
		32.277	9,40
Pipelines – 6,10 % (28. Februar 2019: 5,98 %)			
747	Kinder Morgan Inc/DE	15.135	4,41
265	Plains GP Holdings LP 'A'	5.814	1,69
		20.949	6,10
Einzelhandel – 1,24 % (28. Februar 2019: 2,13 %)			
31	Advance Auto Parts Inc	4.263	1,24
Halbleiter – 2,16 % (28. Februar 2019: 1,15 %)			
96	QUALCOMM Inc	7.431	2,16
Software – 9,17 % (28. Februar 2019: 8,97 %)			
143	Microsoft Corp	19.668	5,73
227	Oracle Corp	11.836	3,44
		31.504	9,17

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Transportwesen – 1,47 % (28. Februar 2019: 1,58 %)			
60	CH Robinson Worldwide Inc	5.063	1,47
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 285.061)		311.035	90,57
Vorzugsaktien – 0,90 % (28. Februar 2019: 0,97 %)			
Automobilhersteller – 0,90 % (28. Februar 2019: 0,97 %)			
EUR 19	Volkswagen AG	3.108	0,90
Vorzugsaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 3.276)		3.108	0,90
Immobilienfonds (REIT) - 1,92 % (28. Februar 2019: 1,64 %)			
REITs – 1,92 % (28. Februar 2019: 1,64 %)			
258	American Homes 4 Rent 'A'	6.583	1,92
Summe Immobilienfonds (REIT) (Anschaffungskosten USD 4.502)		6.583	1,92
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 292.839)		320.726	93,39
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		320.726	93,39
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(3)	–
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(3)	–
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten		320.723	93,39
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		22.693	6,61
Nettovermögen insgesamt		USD 343.416	100,00

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

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt
EUR – Euro

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,24
Sonstige Vermögenswerte	6,76
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
09.04.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	8	Verkauf	USD	9	USD	–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	22	Verkauf	USD	25		–
09.12.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	779	Verkauf	USD	564		(3)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2)									–
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)									(3)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2)								USD	(3)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inven-tar-werts
Stammaktien – 93,36 % (28. Februar 2019: 95,28 %)			
Belgien – 1,94 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
3	Anheuser-Busch InBev NV, ADR ADR	302	1,94
Brasilien – 2,41 % (28. Februar 2019: 2,88 %)			
BRL 67	Duratex SA	214	1,37
20	Itau Unibanco Holding SA, ADR	162	1,04
		376	2,41
Kanada – 1,11 % (28. Februar 2019: 0,87 %)			
CAD 39	Encana Corp	173	1,11
China – 4,26 % (28. Februar 2019: 3,62 %)			
2	Baidu, Inc., ADR	235	1,51
HKD 221	China Development Bank Corp	164	1,05
HKD 351	Greatview Aseptic Packaging Co Ltd	192	1,23
HKD 37	Travelsky Technology Ltd	73	0,47
		664	4,26
Denmark – 1,38 % (28. Februar 2019: 1,19 %)			
DKK	AP Moeller - Maersk A/S	195	1,25
DKK	Bohrco von 1972 A/S/The	20	0,13
		215	1,38
Frankreich – 11,41 % (28. Februar 2019: 9,35 %)			
EUR 2	Atos SE	166	1,06
EUR 6	AXA SA	141	0,91
EUR 6	BNP Paribas SA	284	1,82
EUR 4	Bouygues SA	168	1,08
EUR 5	Danone SA	450	2,89
EUR 2	Safran SA	251	1,61
EUR 5	Total SA	264	1,69
EUR 1	Worldline SA/Frankreich, 144A	55	0,35
		1.779	11,41
Deutschland – 7,24 % (28. Februar 2019: 8,28 %)			
EUR 2	BASF SE	151	0,97
EUR 6	Bayer AG	409	2,63
EUR 4	Bayerische Motoren Werke AG	262	1,68
EUR 2	Continental AG	181	1,16
EUR 10	ThyssenKrupp AG	125	0,80
		1.128	7,24
Indien – 2,25 % (28. Februar 2019: 1,97 %)			
31	Infosys Ltd, ADR	351	2,25
Italien – 3,95 % (28. Februar 2019: 4,21 %)			
EUR 23	Anima Holding SPA, 144A	84	0,54
HKD 65	Prada SpA	182	1,17
EUR 40	Saipem Spa	191	1,22
EUR 14	UniCredit Spa	158	1,02
		615	3,95
Japan – 3,35 % (28. Februar 2019: 4,43 %)			
JPY 15	Chiba Bank Ltd/The	72	0,46
JPY 7	Hitachi Ltd	232	1,49
JPY 9	Honda Motor Co Ltd, ADR	218	1,40
		522	3,35
Niederlande – 1,39 % (28. Februar 2019: 1,36 %)			
EUR 2	Akzo Nobel NV	216	1,39
Russland – 1,10 % (28. Februar 2019: 0,70 %)			
25	Gazprom OAO, ADR	171	1,10
Südkorea – 1,16 % (28. Februar 2019: 1,39 %)			
KRW 1	POSCO	128	0,82
KRW 1	Samsung Electronics Co Ltd	53	0,34
		181	1,16
Schweiz – 7,59 % (28. Februar 2019: 6,68 %)			
EGP 2	Zehnder Group AG	94	0,60
EGP 9	Credit Suisse Group AG	101	0,65
GBP 94	Glencore Plc	268	1,72
EGP 6	Julius Bär Gruppe Ltd	250	1,60
EGP 2	Novartis AG	161	1,04
EGP 1	Roche Holding AG	309	1,98
		1.183	7,59
Thailand – 1,73 % (28. Februar 2019: 1,68 %)			
THB 477	Thai Union Group PCL ∞	270	1,73
Großbritannien – 10,54 % (28. Februar 2019: 14,05 %)			
GBP 67	Barclays Plc	111	0,71
GBP 67	BP Plc	409	2,62
25	CNH Industrial NV	257	1,65
GBP 5	Diageo Plc	230	1,48
GBP 69	G4S PLC	146	0,94
GBP 9	Imperial Brands Plc	243	1,56
GBP 32	Standard Chartered Plc	246	1,58
		1.642	10,54
USA – 30,55 % (28. Februar 2019: 30,04 %)			
1	Accenture Plc	141	0,90
2	Allergan Plc	309	1,98
6	American International Group Inc Inc	328	2,10
4	Arconic Inc	102	0,66
8	AT&T Inc	272	1,74
-	AutoZone Inc	363	2,33
6	Imperial Holdings Ltd	156	1,00
5	Cisco Systems Inc	211	1,35
3	Citizens Financial Group Inc	115	0,74
2	CRC Health Corp	147	0,94
96	CYBG PLC	165	1,06
5	Dr. Horton Inc	258	1,66
2	Eaton Corp Plc	127	0,81
3	Exelon Corp	160	1,03
8	Freeport-Mc Moran Inc	72	0,46
2	Gilead Sciences, Inc.	118	0,76
4	Halliburton Co	74	0,48
1	JPMorgan Chase & Co	152	0,98
4	Lennar Corp	182	1,17
4	Merck & Co Inc	303	1,95
5	NUTRIEN LTD	241	1,55
4	Pfizer Inc	142	0,91
2	Qualcomm Inc	117	0,75
3	Sensata Technologies Holding BP Plc	155	0,99
8	Wells Fargo & Co	351	2,25
		4.761	30,55
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 2.940)		14.549	93,36
Vorzugsaktien – 1,55 % (28. Februar 2019: 1,55 %)			
Deutschland – 1,55 % (28. Februar 2019: 1,55 %)			
EUR 2	Volkswagen AG	241	1,55
Vorzugsaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 243)		241	1,55
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		14.790	94,91
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verlust		14.790	94,91
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		792	5,09
Nettovermögen insgesamt	USD	15.582	100,00

- Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Registrierung befreite Wertpapiere gemäß Regel 144A von Das Securities Act von 1933 in der geänderten Fassung. Diese Wertpapiere dürfen nur weiterverkauft werden, bei Transaktionen ausgenommen Von der Registrierung bis hin zu qualifizierten institutionellen Käufern. Zum 31. August 2019 betrugen diese Wertpapiere USD 139.000 und machten 0,89 % des Nettovermögens aus.

∞ Das Wertpapier wurde vom Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet. Ermessen des Investment Managers.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt
BRL – Brasilianischer Real
CAD – Kanadischer Dollar
CHF – Schweizer Franke
DKK – Dänische Krone
EUR – Euro
GBP – Britisches Pfund
HKD – Hongkong-Dollar
JPY – Japanischer Yen
KRW – Südkoreanischer Won
THB – Thailändischer Baht

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,63
Sonstige Vermögenswerte	5,37
Gesamtvermögen	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Stammaktien – 93,22 % (28. Februar 2019: 97,59 %)			
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung - 2,67 % (28. Februar 2019: 2,95 %)			
21	Raytheon Co	3.876	1,86
13	United Technologies Corp	1.694	0,81
		5.570	2,67
Banken – 7,30 % (28. Februar 2019: 8,20 %)			
110	Bank of America Corp	3.024	1,45
11	Bank of New York Mellon Corp/The	472	0,23
59	JPMorgan Chase & Co	6.522	3,12
8	PNC Financial Services Group Inc/ The	974	0,47
33	US Bancorp	1.740	0,83
54	Wells Fargo & Co	2.507	1,20
		15.239	7,30
Getränke – 2,30 % (28. Februar 2019: 2,16 %)			
44	Coca-Cola Co/The	2.430	1,16
17	PepsiCo Inc	2.371	1,14
		4.801	2,30
Biotechnologie – 0,77 % (28. Februar 2019: 0,67 %)			
14	Corteva Inc	399	0,19
19	Gilead Sciences Inc	1.215	0,58
		1.614	0,77
Baustoffe – 0,88 % (28. Februar 2019: 0,78 %)			
13	Vulcan Materials Co	1.837	0,88
Chemie – 5,25 % (28. Februar 2019: 3,45 %)			
12	Air Products & Chemicals Inc	2.811	1,35
8	DuPont de Nemours Inc	573	0,27
15	Ecolab Inc	3.138	1,50
32	PPG Industries Inc	3.567	1,71
2	Sherwin-Williams Co/The	872	0,42
		10.961	5,25
Gewerbliche Dienstleistungen - 2,01 % (28. Februar 2019: 3,42 %)			
25	Automatic Data Processing Inc	4.198	2,01
Computer – 3,69 % (28. Februar 2019: 3,54 %)			
29	Apple Inc	6.122	2,93
12	International Business Machines Corp	1.586	0,76
		7.708	3,69
Kosmetika & Körperpflege – 1,38 % (28. Februar 2019: 1,27 %)			
24	Procter & Gamble Co/The	2.872	1,38
Distribution und Großhandel – 0,31 % (28. Februar 2019: 0,57 %)			
2	WW Grainger Inc	654	0,31
Diversifiziert – Finanzdienstleistungen – 3,85 % (28. Februar 2019: 3,57 %)			
9	CME Group Inc	2.052	0,98
33	Visa Inc 'A'	5.986	2,87
		8.038	3,85
Elektrik – 0,69 % (28. Februar 2019: 0,66 %)			
3	NextEra Energy Inc	744	0,36
5	Sempra Energy	689	0,33
		1.433	0,69
Elektronik – 2,04 % (28. Februar 2019: 2,15 %)			
26	Honeywell International Inc	4.267	2,04
Umweltkontrolle - 1,33 % (28. Februar 2019: 1,27 %)			
23	Waste Management Inc	2.778	1,33
Lebensmittel – 0,73 % (28. Februar 2019: 0,70 %)			
28	Mondelez International Inc	1.521	0,73
Medizinische Produkte – 4,05 % (28. Februar 2019: 4,17 %)			
7	Becton Dickinson and Co	1.762	0,85
31	Medtronic Plc	3.303	1,58
12	Thermo Fisher Scientific Inc	3.384	1,62
		8.449	4,05
Medizinische Dienstleistungen – 2,10 % (28. Februar 2019: 3,42 %)			
19	UnitedHealth Group Inc	4.396	2,10
Versicherungen – 5,81 % (28. Februar 2019: 5,97 %)			
24	American International Group Inc	1.237	0,59
–	Berkshire Hathaway Inc	6.411	3,07
21	MetLife Inc	950	0,46
24	Travelers Cos Inc/The	3.534	1,69
		12.132	5,81
Internet – 5,83 % (28. Februar 2019: 6,01 %)			
2	Alphabet Inc	2.479	1,19
2	Alphabet Inc 'A'	2.157	1,03
1	Amazon.com Inc	2.251	1,08
28	Facebook Inc 'A'	5.277	2,53
		12.164	5,83
Medien – 5,38 % (28. Februar 2019: 5,24 %)			
152	Comcast Corp	6.701	3,21
33	Walt Disney Co/The	4.539	2,17
		11.240	5,38
Verschiedene verarbeitende Gewerbe – 0,61 % (28. Februar 2019: 0,97 %)			
8	3M Co	1.281	0,61
Öl und Gas – 3,85 % (28. Februar 2019: 5,15 %)			
27	Chevron Corp	3.152	1,51
41	Exxon Mobil Corp	2.816	1,35
9	Phillips 66	919	0,44
9	Pioneer Natural Resources Co	1.151	0,55
		8.038	3,85
Öl- und Gasdienstleistungen – 0,25 % (28. Februar 2019: 0,47 %)			
16	Schlumberger Ltd	513	0,25
Pharmaindustrie – 5,96 % (28. Februar 2019: 7,11 %)			
13	CVS Health Corp	777	0,37
31	Johnson & Johnson	3.991	1,91
56	Merck & Co Inc	4.852	2,32
80	Pfizer Inc	2.834	1,36
		12.454	5,96
Pipelines – 0,85 % (28. Februar 2019: 0,75 %)			
87	Kinder Morgan Inc/DE	1.767	0,85
Einzelhandel – 6,63 % (28. Februar 2019: 6,80 %)			
24	Home Depot Inc/The	5.433	2,60
8	McDonald's Corp	1.713	0,82
52	TJX Cos Inc/The	2.835	1,36
34	WALMART INC	3.864	1,85
		13.845	6,63
Halbleiter – 0,97 % (28. Februar 2019: 0,79 %)			
4	ASML Holding NV	997	0,48
8	Texas Instruments Inc	1.023	0,49
		2.020	0,97
Software – 10,04 % (28. Februar 2019: 9,67 %)			
15	Adobe Inc	4.126	1,97
96	Microsoft Corp	13.258	6,35
24	Oracle Corp	1.245	0,60
11	salesforce.com Inc	1.707	0,82
5	SAP SE ADR	639	0,30
		20.975	10,04
Telekommunikation – 4,07 % (28. Februar 2019: 4,59 %)			
79	AT&T Inc	2.767	1,33
65	Cisco Systems Inc	3.051	1,46
46	Verizon Communications Inc	2.679	1,28
		8.497	4,07
Transportwesen – 1,62 % (28. Februar 2019: 1,12 %)			
29	United Parcel Service Inc 'B'	3.385	1,62
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 124.060)		194.647	93,22
Immobilienfonds (REIT) – 1,99 % (28. Februar 2019: 1,71 %)			
REITs – 1,99 % (28. Februar 2019: 1,71 %)			
18	American Tower Corp	4.156	1,99
Summe Immobilienfonds (REIT) (Anschaffungskosten USD 1.531)		4.156	1,99
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 125.591)		198.803	95,21
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		–	–
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		198.803	95,21
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert		198.803	95,21
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		10.010	4,79
Nettovermögen insgesamt	USD	208.813	100,00

– Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,78
Derivate	–
Sonstige Vermögenswerte	5,22
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
09.03.2019	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–	USD	–
09.04.2019	BNY Mellon	Kauf	USD	50	Verkauf	EUR	45		–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)									–
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)									–
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)								USD	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inven-tar-werts
Stammaktien – 96,73 % (28. Februar 2019: 97,39 %)			
Getränke – 2,07 % (28. Februar 2019: 3,11 %)			
293	Anheuser-Busch InBev SA/NV ADR	27.638	2,07
Biotechnologie – 2,41 % (28. Februar 2019: 5,67 %)			
186	Alexion Pharmaceuticals Inc	18.768	1,41
178	BioMarin Pharmaceutical Inc	13.366	1,00
		32.134	2,41
Chemie – 3,72 % (28. Februar 2019: 1,62 %)			
135	Ecolab Inc	27.778	2,08
116	Linde Plc	21.825	1,64
		49.603	3,72
Gewerbliche Dienstleistungen – 1,75 % (28. Februar 2019: 5,57 %)			
356	IHS Markit Ltd	23.321	1,75
Computer – 2,92 % (28. Februar 2019: 3,43 %)			
143	Apple Inc	29.801	2,23
378	Nutanix Inc	9.160	0,69
		38.961	2,92
Distribution und Großhandel – 1,79 % (28. Februar 2019: 2,16 %)			
87	WW Grainger Inc	23.879	1,79
Diversifiziert – Finanzdienstleistungen – 9,47 % (28. Februar 2019: 9,28 %)			
191	American Express Co	23.027	1,73
44	BlackRock Inc	18.747	1,41
578	Charles Schwab Corp/The	22.118	1,66
345	Visa Inc 'A'	62.293	4,67
		126.185	9,47
Elektronik – 2,10 % (28. Februar 2019: 2,33 %)			
170	Honeywell International Inc	27.958	2,10
Lebensmittel – 1,07 % (28. Februar 2019: 0,95 %)			
87	MCCORMICK & CO INC/MD	14.195	1,07
Medizinische Produkte – 2,54 % (28. Februar 2019: 2,27 %)			
118	Thermo Fisher Scientific Inc	33.785	2,54
Medizinische Dienstleistungen – 3,01 % (28. Februar 2019: 2,77 %)			
172	UnitedHealth Group Inc	40.109	3,01
Internet – 21,63 % (28. Februar 2019: 18,67 %)			
133	Alibaba Group Holding Ltd ADR	23.195	1,74
34	Alphabet Inc	39.918	3,00
13	Alphabet Inc 'A'	15.872	1,19
46	Amazon.com Inc	82.535	6,19
6	Booking Holdings Inc	12.077	0,91
368	Facebook Inc 'A'	68.384	5,13
188	GrubHub Inc	11.162	0,84
99	Palo Alto Networks Inc	20.122	1,51
458	Uber Technologies Inc	14.899	1,12
		288.164	21,63
Maschinenbau - Bau und Bergbau – 0,76 % (28. Februar 2019: 1,28 %)			
85	Caterpillar Inc	10.165	0,76
Medien – 4,79 % (28. Februar 2019: 4,42 %)			
633	Comcast Corp	27.985	2,10
261	Walt Disney Co/The	35.844	2,69
		63.829	4,79
Öl und Gas – 1,07 % (28. Februar 2019: 0,81 %)			
115	Pioneer Natural Resources Co	14.237	1,07
Pharmaindustrie – 4,50 % (28. Februar 2019: 3,61 %)			
179	Johnson & Johnson	22.992	1,73
292	Zoetis Inc	36.948	2,77
		59.940	4,50
Einzelhandel – 7,21 % (28. Februar 2019: 6,46 %)			
143	Advance Auto Parts Inc	19.783	1,49
27	Chipotle Mexican Grill Inc 'A'	22.994	1,73
83	Costco Wholesale Corp	24.541	1,84
126	Home Depot Inc/The	28.662	2,15
		95.980	7,21
Halbleiter – 5,14 % (28. Februar 2019: 4,15 %)			
91	NVIDIA Corp	15.187	1,14
376	QUALCOMM Inc	29.207	2,19
194	Texas Instruments Inc	24.042	1,81
		68.436	5,14
Software – 15,72 % (28. Februar 2019: 16,29 %)			
135	Adobe Inc	38.314	2,88
325	Akamai Technologies Inc	28.960	2,17
111	Fidelity National Information Services Inc	15.048	1,13
486	Microsoft Corp	66.988	5,03
523	Oracle Corp	27.194	2,04
169	Splunk Inc	18.897	1,42
99	VMware Inc	13.972	1,05
		209.373	15,72
Transportwesen – 3,06 % (28. Februar 2019: 1,52 %)			
130	CH Robinson Worldwide Inc	11.017	0,83
251	United Parcel Service Inc 'B'	29.765	2,23
		40.782	3,06
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten USD 1.094.589)		1.288.674	96,73
Immobilienfonds (REIT) – 1,82 % (28. Februar 2019: 1,77 %)			
REITs – 1,82 % (28. Februar 2019: 1,77 %)			
44	Equinix Inc	24.261	1,82
Summe Immobilienfonds (REIT) (Anschaffungskosten USD 18.103)		24.261	1,82
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Anschaffungskosten USD 1.112.692)		1.312.935	98,55
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,02 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		65	–
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		1.313.000	98,55
Devisenterminkontrakte – (0,12 %) (28. Februar 2019: (0,01 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(1.651)	(0,12)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert finanzielle Verbindlichkeiten		(1.651)	(0,12)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete bewertete finanzielle Vermögenswerte		1.311.349	98,43
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		20.839	1,57
Nettovermögen insgesamt	USD	1.332.188	100,00

– Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,96
Derivate	–
Sonstige Vermögenswerte	2,04
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
09.03.2019	BNY Mellon	Kauf	USD	4.204	Verkauf	BRL	17.299	USD	27
09.03.2019	BNY Mellon	Kauf	USD	236	Verkauf	EUR	211		2
09.03.2019	BNY Mellon	Kauf	GBP	2	Verkauf	USD	3		–
09.03.2019	BNY Mellon	Kauf	EUR	19	Verkauf	USD	21		–
09.03.2019	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–		–
09.03.2019	BNY Mellon	Kauf	BRL	17.298	Verkauf	USD	4.553		(377)
09.04.2019	BNY Mellon	Kauf	USD	42	Verkauf	EUR	39		–
09.04.2019	BNY Mellon	Kauf	EUR	97	Verkauf	USD	107		(1)
09.12.2019	BNY Mellon	Kauf	USD	2.368	Verkauf	EUR	2.120		36
09.12.2019	BNY Mellon	Kauf	EUR	54.182	Verkauf	USD	60.859		(1.262)
10.01.2019	BNY Mellon	Kauf	BRL	15.341	Verkauf	USD	3.709		(11)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 260)									65
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (157))									(1.651)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 103)									USD (1.586)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventarwerts
Stammaktien – 99,65 % (28. Februar 2019: 98,68 %)			
Biotechnologie – 17,23 % (28. Februar 2019: 18,15 %)			
158	Amgen Inc	33.052	2,97
369	Biogen Inc	81.113	7,28
234	Immunogen Inc	636	0,06
532	Ionis Pharmaceuticals Inc	33.657	3,02
56	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	3.054	0,27
225	Vertex Pharmaceuticals Inc	40.432	3,63
		191.944	17,23
Baustoffe – 2,03 % (28. Februar 2019: 2,48 %)			
530	Johnson Controls International plc	22.633	2,03
Computer – 7,05 % (28. Februar 2019: 5,66 %)			
5	Science Applications International Corp	404	0,03
1.089	Seagate Technology Plc	54.677	4,91
410	Western Digital Corp	23.485	2,11
		78.566	7,05
Diversifiziert – Finanzdienstleistungen – 0,17 % (28. Februar 2019: 0,10 %)			
36	Cohen & Steers Inc	1.937	0,17
Elektronik – 3,76 % (28. Februar 2019: 3,22 %)			
19	nVent Electric Plc	390	0,04
454	TE Connectivity Ltd	41.446	3,72
		41.836	3,76
Technik und Bau – 0,26 % (28. Februar 2019: 1,33 %)			
164	Fluor Corp	2.906	0,26
Unterhaltung – 2,96 % (28. Februar 2019: 3,40 %)			
505	Lions Gate Entertainment Corp	4.212	0,38
114	Madison Square Garden Co/The	28.809	2,58
		33.021	2,96
Umweltkontrolle – 0,14 % (28. Februar 2019: 0,12 %)			
45	Pentair Plc	1.606	0,14
Medizinische Produkte – 1,55 % (28. Februar 2019: 1,40 %)			
157	Medtronic Plc	16.919	1,52
15	Wright Medical Group NV	321	0,03
		17.240	1,55
Medizinische Dienstleistungen – 5,22 % (28. Februar 2019: 6,55 %)			
249	UnitedHealth Group Inc	58.125	5,22
Einrichtungsgegenstände – 0,64 % (28. Februar 2019: 0,51 %)			
116	Dolby Laboratories Inc 'A'	7.135	0,64
Internet – 5,16 % (28. Februar 2019: 3,27 %)			
15	Facebook Inc 'A'	2.770	0,25
264	FireEye Inc	3.546	0,32
1.200	Twitter Inc	51.162	4,59
		57.478	5,16
Eisen/Stahl – 0,74 % (28. Februar 2019: 0,99 %)			
169	Nucor Corp	8.292	0,74
Medien – 24,93 % (28. Februar 2019: 21,06 %)			
646	AMC Networks Inc	31.318	2,81
26	CBS Corp 'B'	1.110	0,10
2.029	Comcast Corp	89.712	8,05
1.365	Discovery Inc	37.666	3,38
455	Discovery Inc	11.840	1,06
188	Liberty Broadband Corp	19.645	1,76
270	Liberty Broadband Corp	28.454	2,55
21	Liberty Global Plc	551	0,05
63	Liberty Global Plc	1.637	0,15
58	Liberty Media Corp-Liberty Braves	1.592	0,14
29	Liberty Media Corp-Liberty Braves	796	0,07
73	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	2.874	0,26
138	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	5.743	0,52
535	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	21.844	1,96
280	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	11.335	1,02
537	MSG Networks Inc	8.814	0,79
22	Viacom Inc 'B'	540	0,05
32	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	2.282	0,21
		277.753	24,93
Bergbau – 0,73 % (28. Februar 2019: 0,82 %)			
888	Freeport-McMoRan Inc	8.157	0,73
Öl und Gas – 1,58 % (28. Februar 2019: 4,14 %)			
2.897	Encana Corp	12.850	1,15
110	Occidental Petroleum Corp	4.763	0,43
		17.613	1,58
Öl- und Gasdienstleistungen – 3,24 % (28. Februar 2019: 4,31 %)			
420	Core Laboratories NV	16.630	1,49
829	National Oilwell Varco Inc	16.941	1,52
215	NOW Inc	2.553	0,23
		36.124	3,24
Pharmaindustrie – 5,40 % (28. Februar 2019: 5,20 %)			
191	Agios Pharmaceuticals Inc	7.248	0,65
43	Alkermes Plc	910	0,08
262	Allergan Plc	41.748	3,75
385	Bausch Health Cos Inc	8.220	0,74
93	ProQR Therapeutics NV	672	0,06
76	Voyager Therapeutics Inc	1.358	0,12
		60.156	5,40
Einzelhandel – 0,16 % (28. Februar 2019: 0,20 %)			
168	Qurate Retail Inc	1.800	0,16
Sparkassen – 0,33 % (28. Februar 2019: 0,26 %)			
243	New York Community Bancorp Inc	2.804	0,25
47	Sterling Bancorp/DE	894	0,08
		3.698	0,33
Halbleiter – 6,93 % (28. Februar 2019: 6,56 %)			
173	Broadcom Inc	48.925	4,39
572	Cree Inc	24.564	2,21
78	Intel Corp	3.687	0,33
		77.176	6,93
Software – 8,80 % (28. Februar 2019: 8,44 %)			
251	Autodesk Inc	35.791	3,21
221	Citrix Systems Inc	20.594	1,85
2.479	Nuance Communications Inc	41.657	3,74
		98.042	8,80
Telekommunikation – 0,64 % (28. Februar 2019: 0,49 %)			
100	AT&T Inc	3.535	0,32
24	GCI Liberty Inc	1.521	0,14
30	LogMeIn Inc	2.020	0,18
		7.076	0,64
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten USD 1.027.781)		1.110.314	99,65
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Anschaffungskosten USD 1.027.781)		1.110.314	99,65
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,03 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		6	–
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		1.110.320	99,65
Devisenterminkontrakte – (0,08 %) (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(882)	(0,08)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert finanzielle Verbindlichkeiten		(882)	(0,08)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete bewertete finanzielle Vermögenswerte		1.109.438	99,57
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		4.814	0,43
Nettovermögen insgesamt	USD	1.114.252	100,00

– Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,06
Derivate	–
Sonstige Vermögenswerte	0,94
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	AUD	–	USD –
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf	EUR	6	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	11	Verkauf	USD	8	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	16	Verkauf	USD	18	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	219	Verkauf	USD	268	(1)
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	49	Verkauf	EUR	44	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	12	Verkauf	USD	13	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	430	Verkauf	USD	523	(1)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	114	Verkauf	AUD	168	2
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	9	Verkauf	CNH	64	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	360	Verkauf	EUR	324	4
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	1	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	68	Verkauf	GBP	57	(1)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	SGD	11		USD –
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	325	Verkauf	USD	34		(1)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	3.241	Verkauf	USD	841		(27)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	80	Verkauf	USD	96		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	10.797	Verkauf	USD	13.150		(6)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CHF	227	Verkauf	USD	233		(4)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	1	Verkauf	USD	1		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	32.240	Verkauf	USD	36.210		(750)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CNH	3.288	Verkauf	USD	465		(6)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	2.554	Verkauf	USD	1.850		(10)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	15.398	Verkauf	USD	10.450		(75)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 523)									6
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (44))									(882)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 479)									USD (876)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien – 73,09 % (28. Februar 2019: 76,44 %)			
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung – 3,51 % (28. Februar 2019: 3,21 %)			
5	Raytheon Co	927	2,09
5	United Technologies Corp	629	1,42
		1.556	3,51
Landwirtschaft – 0,19 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
2	Altria Group Inc	85	0,19
Automobilhersteller – 0,38 % (28. Februar 2019: 0,63 %)			
5	General Motors Co	169	0,38
Banken – 1,21 % (28. Februar 2019: 3,05 %)			
20	Bank of America Corp	536	1,21
Getränke – 1,42 % (28. Februar 2019: 1,87 %)			
6	Coca-Cola Co/The	340	0,76
2	PepsiCo Inc	293	0,66
		633	1,42
Biotechnologie – 0,64 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
10	Corteva Inc	284	0,64
Chemie – 1,47 % (28. Februar 2019: 2,03 %)			
6	Dow Inc	251	0,57
6	DuPont de Nemours Inc	401	0,90
		652	1,47
Computer – 5,28 % (28. Februar 2019: 3,69 %)			
7	Apple Inc	1.403	3,16
3	International Business Machines Corp	363	0,82
10	Western Digital Corp	575	1,30
		2.341	5,28
Kosmetika & Körperpflege – 1,87 % (28. Februar 2019: 1,65 %)			
7	Procter & Gamble Co/The	829	1,87
Diversifiziert – Finanzdienstleistungen – 1,04 % (28. Februar 2019: 0,82 %)			
5	Intercontinental Exchange Inc	460	1,04
Elektrik – 5,70 % (28. Februar 2019: 7,00 %)			
8	Brookfield Infrastructure Partners LP, MLP #	370	0,83
18	Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP #	685	1,55
8	CenterPoint Energy Inc	219	0,49
5	Edison International	363	0,82
4	Exelon Corp	191	0,43
3	NextEra Energy Inc	701	1,58
		2.529	5,70
Elektrische Komponenten und Zubehör – 0,73 % (28. Februar 2019: 0,86 %)			
5	Emerson Electric Co	322	0,73
Papier- und Holzprodukte – 0,28 % (28. Februar 2019: 1,06 %)			
3	International Paper Co	123	0,28
Hand- und Maschinenwerkzeuge – 1,64 % (28. Februar 2019: 1,83 %)			
5	Stanley Black & Decker Inc	729	1,64
Haushaltswaren und -artikel – 1,42 % (28. Februar 2019: 1,38 %)			
4	Kimberly-Clark Corp	629	1,42
Versicherungen – 0,42 % (28. Februar 2019: 0,96 %)			
4	MetLife Inc	188	0,42
Investmentgesellschaften – 4,91 % (28. Februar 2019: 3,87 %)			
30	Ares Capital Corp	560	1,26
14	Golub Capital BDC Inc	264	0,59
30	Owl Rock Capital Corp	472	1,07
55	TriplePoint Venture Growth BDC Corp	883	1,99
		2.179	4,91
Pharmaindustrie – 6,08 % (28. Februar 2019: 7,58 %)			
5	Johnson & Johnson	595	1,34
16	Merck & Co Inc	1.339	3,02
21	Pfizer Inc	763	1,72
		2.697	6,08
Pipelines – 10,50 % (28. Februar 2019: 10,74 %)			
20	Enbridge Inc	669	1,51
49	Kinder Morgan Inc/DE	994	2,24
17	ONEOK Inc	1.176	2,65
32	Rattler Midstream LP, MLP #	579	1,31
13	Targa Resources Corp	484	1,09
32	Williams Cos Inc/The	755	1,70
		4.657	10,50
Private Equity – 0,58 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
5	Blackstone Group Inc/The	256	0,58
Halbleiter – 8,65 % (28. Februar 2019: 7,95 %)			
3	Broadcom Inc	907	2,04
6	Intel Corp	304	0,68
9	Maxim Integrated Products Inc	496	1,12
7	Microchip Technology Inc	611	1,38
10	QUALCOMM Inc	777	1,75
6	Texas Instruments Inc	744	1,68
		3.839	8,65
Software – 6,59 % (28. Februar 2019: 7,49 %)			
16	Microsoft Corp	2.207	4,97
3	Oracle Corp	175	0,40
7	Paychex Inc	539	1,22
		2.921	6,59
Telekommunikation - 5,26% (28. Februar 2019: 5,12 %)			
31	AT&T Inc	1.095	2,47
8	Cisco Systems Inc	366	0,83
15	Verizon Communications Inc	872	1,96
		2.333	5,26
Transportwesen – 3,32 % (28. Februar 2019: 3,65 %)			
45	Hoegh LNG Partners LP	663	1,50
44	KNOT Offshore Partners LP, MLP #	808	1,82
		1.471	3,32
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 27.449)		32.418	73,09
Vorzugsaktien – 2,97 % (28. Februar 2019: 2,90 %)			
Elektrik – 1,78 % (28. Februar 2019: 1,87 %)			
3	Sempra Energy, Series A	373	0,84
4	Sempra Energy, Series B	413	0,94
		786	1,78
Medizinische Produkte – 1,19 % (28. Februar 2019: 1,03 %)			
–	Danaher Corp, Series A	529	1,19
Vorzugsaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 1.168)		1.315	2,97
Immobilienfonds (REIT) – 20,21 % (28. Februar 2019: 19,47 %)			
REITs – 20,21 % (28. Februar 2019: 19,47 %)			
31	AGNC Investment Corp	461	1,04
5	Alexandria Real Estate Equities Inc	721	1,62
4	American Tower Corp	895	2,02
13	Apartment Investment & Management Co	673	1,52
3	AvalonBay Communities Inc	546	1,23
1	Crown Castle International Corp, Series A	826	1,86
6	EPR Properties	495	1,12
4	Equity Residential	360	0,81
12	Park Hotels & Resorts Inc	287	0,65
31	Retail Properties of America Inc	348	0,78
5	Simon Property Group Inc	714	1,61
35	Starwood Property Trust Inc	821	1,85
16	STORE Capital Corp	620	1,40
23	TPG RE Finance Trust Inc	453	1,02
27	Two Harbors Investment Corp	337	0,76
16	Weyerhaeuser Co	408	0,92
		8.965	20,21
Summe Immobilienfonds (REIT) (Anschaffungskosten USD 8.319)		8.965	20,21
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 36.936)		42.698	96,27
Devisenterminkontrakte – 0,00% (28. Februar 2019: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1	–
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		42.699	96,27
Devisenterminkontrakte – (0,06%) (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(28)	(0,06)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		(28)	(0,06)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		42.671	96,21
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		1.681	3,79
Nettovermögen insgesamt	USD	44.352	100,00

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

\# Master Limited Partnership.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,53
Derivate	–
Sonstige Vermögenswerte	4,47
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	7	Verkauf	AUD	10	USD –
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	CNH	4	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	57	Verkauf	EUR	51	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	1	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	168	Verkauf	USD	122	(1)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	554	Verkauf	USD	621	(13)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CNH	960	Verkauf	USD	136	(2)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	2.558	Verkauf	USD	1.736	(12)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	USD	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 6)								1
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (3))								(28)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 3)								USD (27)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Stammaktien – 95,63 % (28. Februar 2019: 96,75 %)		
Bekleidung – 2,42 % (28. Februar 2019: 3,14 %)		
4 Nike Inc	314	2,42
Banken – 6,43 % (28. Februar 2019: 6,68 %)		
13 Bank of America Corp	350	2,69
2 First Republic Bank/CA	205	1,59
5 US Bancorp	279	2,15
	834	6,43
Biotechnologie – 2,92 % (28. Februar 2019: 5,69 %)		
1 Ariad Pharmaceuticals Inc	136	1,05
3 BioMarin Pharmaceutical Inc	242	1,87
	378	2,92
Baustoffe – 3,10 % (28. Februar 2019: 2,95 %)		
5 Trex Co Inc	402	3,10
Chemie – 3,19 % (28. Februar 2019: 0,00 %)		
2 Ecolab Inc	414	3,19
Gewerbliche Dienstleistungen – 3,07 % (28. Februar 2019 6,87 %)		
2 Automatic Data Processing Inc	399	3,07
Computer – 4,55 % (28. Februar 2019: 3,60 %)		
3 Apple Inc	591	4,55
Kosmetika & Körperpflege – 4,29 % (28. Februar 2019 4,04 %)		
3 Colgate-Palmolive Co	209	1,61
6 Unilever NV	348	2,68
	557	4,29
Diversifiziert – Finanzdienstleistungen – 6,45 % (28. Februar 2019 7,11 %)		
1 BlackRock Inc	266	2,05
6 Charles Schwab Corp/The 19.801	215	1,66
2 Visa Inc 'A'	356	2,74
	837	6,45
Elektrik – 5,61 % (28. Februar 2019: 4,95 %)		
6 Brookfield Renewable Energy PARTNER LP/CA, MLP #	218	1,68
1 NextEra Energy Inc	274	2,11
3 Orasure Technologies Inc	236	1,82
	728	5,61
Elektronik – 1,77 % (28. Februar 2019: 0,00 %)		
2 Orasure Technologies Inc	230	1,77
Alternative Energiequellen - 3,54 % (28. Februar 2019 2,98 %)		
3 Orasure Technologies Inc	268	2,06
8 Vestas Wind Systems A/S ADR	191	1,48
	459	3,54
Umweltkontrolle – 1,26 % (28. Februar 2019 0,68 %)		
11 Evoqua Water Technologies Corp	163	1,26
Medizinische Produkte – 5,00 % (28. Februar 2019 5,69 %)		
1 Becton Dickinson und Co	292	2,25
3 Danaher Corp	357	2,75
	649	5,00
Medizinische Dienstleistungen – 1,51 % (28. Februar 2019: 3,39 %)		
1 UnitedHealth Group Inc	196	1,51
Versicherungen – 4,36 % (28. Februar 2019: 4,19 %)		
4 Hartford Financial Services Group Inc Inc/Der	246	1,90
4 Progressive Corp./The	320	2,46
	566	4,36
Internet – 5,00 % (28. Februar 2019: 4,38 %)		
- Alphabet Inc 'A'	526	4,06
3 Lyft Inc	123	0,94
	649	5,00
Maschinenanlagen - diversifiziert - 2,80 % (28. Februar 2019 3,30 %)		
1 Brooks Automation Inc	159	1,22
3 XYLEM INC/NY	205	1,58
	364	2,80
Medien – 2,63 % (28. Februar 2019: 2,47 %)		
2 Walt Disney Co	342	2,63
Verschiedene verarbeitende Gewerbe – 2,19 % (28. Februar 2019 2,07 %)		
2 Ingersoll-Rand-Sps	285	2,19
Büroausstattung – 1,29 % (28. Februar 2019: 1,31 %)		
4 Herman Miller Inc	167	1,29
Pharmaindustrie – 2,18 % (28. Februar 2019: 0,00 %)		
3 Merck & Co Inc	283	2,18
Immobilien – 1,39 % (28. Februar 2019: 1,85 %)		
1 Jones Lang LaSalle Inc	181	1,39
Einzelhandel – 8,95 % (28. Februar 2019: 7,39 %)		
2 Costco Wholesale Corp.	454	3,50
2 Home Depot Inc	362	2,79
4 Starbucks Corp	346	2,66
	1.162	8,95
Halbleiter – 2,06 % (28. Februar 2019: 1,18 %)		
1 Lam Research Corp	267	2,06
Software – 7,67 % (28. Februar 2019: 8,09 %)		
1 Autodesk Inc	210	1,62
6 Microsoft Corp	786	6,05
	996	7,67
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 11.027)	12.413	95,63
Immobilienfonds (REIT) – 2,31 % (28. Februar 2019 1,88 %)		
REITs – 2,31 % (28. Februar 2019: 1,88 %)		
1 Equinix Inc	300	2,31
Summe Immobilienfonds (REIT) (Anschaffungskosten USD 240)	300	2,31
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 11.267)	12.713	97,94
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019 0,03 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	-	-
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	12.713	97,94
Devisenterminkontrakte – (0,10 %) (28. Februar 2019: 0,01 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(12)	(0,10)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	(12)	(0,10)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	12.701	97,84
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	279	2,16
Gesamtnettovermögen	USD 12.980	100,00

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

\# Master Limited Partnership.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,62
Derivate	-
Sonstige Vermögenswerte	2,38
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
04.09.2019	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	-	USD –
04.09.2019	BNY Mellon	Kauf	GBP	-	Verkauf	USD	-	-
12.09.2019	BNY Mellon	Kauf	EUR	530	Verkauf	USD	595	(12)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2)								-
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (1))								(12)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 1)								USD (12)

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inven-tar-werts
Investmentfonds – 1,40 % (28. Februar 2019: 2,36 %)			
7.155	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (ausschüttend)	7.155	1,40
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 7.155)		7.155	1,40
Stammaktien – 98,54 % (28. Februar 2019: 98,49 %)			
Werbung – 0,86 % (28. Februar 2019: 0,48 %)			
442	Telaria Inc	4.411	0,86
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung – 0,86 % (28. Februar 2019: 2,69 %)			
62	Kratos Defense & Security Solutions Inc	1.236	0,24
125	Triumph Group Inc	2.604	0,51
52	Wesco Aircraft Holdings Inc	574	0,11
		4.414	0,86
Landwirtschaft – 0,39 % (28. Februar 2019: 0,25 %)			
118	Tejon Ranch Co	1.978	0,39
Fluggesellschaften – 0,46 % (28. Februar 2019: 0,31 %)			
61	Hawaiian Holdings Inc	1.488	0,29
133	Mesa Air Group Inc	858	0,17
		2.346	0,46
Bekleidung – 0,82 % (28. Februar 2019: 0,75 %)			
54	Jerash Holdings US Inc	386	0,08
165	Unifi Inc	3.183	0,62
51	Vince Holding Corp	625	0,12
		4.194	0,82
Automobilhersteller – 0,26 % (28. Februar 2019: 0,31 %)			
97	Wabash National Corp	1.328	0,26
Kfz-Teile und Zubehör – 2,96% (28. Februar 2019: 4,47 %)			
298	Commercial Vehicle Group Inc	1.888	0,37
543	Horizon Global Corp	2.275	0,45
71	Meritor Inc	1.186	0,23
227	Modine Manufacturing Co	2.316	0,45
278	Spartan Motors Inc	3.501	0,68
1.492	Westport Fuel Systems Inc	3.976	0,78
		15.142	2,96
Banken – 6,31 % (28. Februar 2019: 5,59 %)			
43	Allegiance Bancshares Inc	1.376	0,27
153	CenterState Bank Corp	3.452	0,68
156	First Foundation Inc	2.179	0,43
110	Franklin Financial Network Inc	3.184	0,62
219	Hilltop Holdings Inc	5.196	1,02
68	Independent Bank Group Inc	3.316	0,65
88	Seacoast Banking Corp of Florida	2.042	0,40
99	Southern National Bancorp of Virginia Inc	1.450	0,28
38	Texas Capital Bancshares Inc	2.059	0,40
143	Tristate Capital Holdings Inc	2.822	0,55
55	Umpqua Holdings Corp	860	0,17
77	Walker & Dunlop Inc	4.293	0,84
		32.229	6,31
Getränke – 0,07 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
190	Reed's Inc	350	0,07
Biotechnologie – 0,91 % (28. Februar 2019: 0,75 %)			
81	AMAG Pharmaceuticals Inc	879	0,17
86	Emergent BioSolutions Inc	3.766	0,74
		4.645	0,91
Baustoffe – 3,65 % (28. Februar 2019: 2,63 %)			
49	American Woodmark Corp	4.058	0,79
35	Apogee Enterprises Inc	1.284	0,25
54	Builders FirstSource Inc	1.059	0,21
86	Cornerstone Building Brands Inc	404	0,08
595	Forterra Inc	3.554	0,70
205	Griffon Corp	3.573	0,70
122	LSI Industries Inc	550	0,11
145	PGT Innovations Inc	2.314	0,45
45	US Concrete Inc	1.836	0,36
		18.632	3,65
Chemie – 2,69 % (28. Februar 2019: 3,95 %)			
16	American Vanguard Corp	225	0,04
167	Ferro Corp	1.698	0,33
168	Huntsman Corp	3.338	0,65
644	Intrepid Potash Inc	1.916	0,38
154	Kraton Corp	4.220	0,83
118	Olin Corp	1.997	0,39
96	Rayonier Advanced Materials Inc	338	0,07
		13.732	2,69
Gewerbliche Dienstleistungen – 4,84 % (28. Februar 2019: 3,77 %)			
35	CAI International Inc	732	0,14
75	CoreLogic Inc/United States	3.627	0,71
433	Cross Country Healthcare Inc	4.435	0,87
88	GP Strategies Corp	1.133	0,22
127	Herc Holdings Inc	5.226	1,02
279	Hertz Global Holdings Inc	3.381	0,66
313	R1 RCM Inc	3.651	0,72
154	Team Inc	2.532	0,50
		24.717	4,84
Computer – 2,30 % (28. Februar 2019: 3,90 %)			
125	3D Systems Corp	877	0,17
81	NCR Corp	2.549	0,50
178	Perspecta Inc	4.622	0,91
183	SecureWorks Corp	2.206	0,43
62	Stratasys Ltd	1.486	0,29
		11.740	2,30
Distribution und Großhandel – 0,79 % (28. Februar 2019: 0,08 %)			
80	Fossil Group Inc	1.019	0,20
92	Manitex International Inc	519	0,10
182	Resideo Technologies Inc	2.511	0,49
		4.049	0,79
Diversifiziert – Finanzdienstleistungen – 1,79 % (28. Februar 2019: 0,75 %)			
132	Air Lease Corp 'A'	5.492	1,08
136	B. Riley Financial Inc	2.885	0,56
8	Evercore Inc 'A'	670	0,13
18	GAIN Capital Holdings Inc	83	0,02
		9.130	1,79
Elektrik – 0,65 % (28. Februar 2019: 0,13 %)			
232	Ameresco Inc	3.334	0,65
Elektrische Komponenten und Zubehör – 1,27 % (28. Februar 2019: 0,31 %)			
59	Generac Holdings Inc	4.600	0,90
102	Insteel Industries Inc	1.907	0,37
		6.507	1,27
Elektronik – 3,81 % (28. Februar 2019: 4,58 %)			
49	Advanced Energy Industries Inc	2.517	0,49
140	Applied Optoelectronics Inc	1.241	0,24
174	Comtech Telecommunications Corp	4.647	0,91
40	Identiv Inc	197	0,04
101	II-VI Inc	3.792	0,74
78	IntriCon Corp	1.350	0,27
185	KEMET Corp	3.107	0,61
164	Vishay Intertechnology Inc	2.596	0,51
		19.447	3,81
Technik und Bau – 3,11 % (28. Februar 2019: 2,52 %)			
138	Aegion Corp 'A'	2.723	0,53
87	Arcosa Inc	2.836	0,56
97	Construction Partners Inc	1.604	0,31
83	frontdoor Inc	4.282	0,84
25	Granite Construction Inc	715	0,14
53	Great Lakes Dredge & Dock Corp	570	0,11
94	Mistras Group Inc	1.375	0,27
93	Primoris Services Corp	1.813	0,35
		15.918	3,11
Unterhaltung – 0,29 % (28. Februar 2019: 0,12 %)			
82	Scientific Games Corp	1.506	0,29
Umweltkontrolle – 0,15 % (28. Februar 2019: 0,08 %)			
69	Pure Cycle Corp	751	0,15
Lebensmittel – 0,28 % (28. Februar 2019: 0,90 %)			
46	Landec Corp	502	0,10
408	SunOpta Inc	940	0,18
		1.442	0,28
Papier- und Holzprodukte – 0,25 % (28. Februar 2019: 0,11 %)			
89	PH Glatfelter Co	1.279	0,25
Hand- und Maschinenwerkzeuge – 0,20 % (28. Februar 2019: 0,62 %)			
64	Milacron Holdings Corp	1.013	0,20
Medizinische Produkte – 3,27 % (28. Februar 2019: 2,93 %)			
627	Accuray Inc	1.676	0,33
142	Alphatec Holdings Inc	742	0,14
178	AngioDynamics Inc	3.263	0,64
53	BioTelemetry Inc	2.094	0,41
85	CareDx Inc	1.941	0,38
3	Conformis Inc	7	–
687	Invacare Corp	3.321	0,65
91	RA Medical Systems Inc	139	0,03
255	RTI Surgical Holdings Inc	808	0,16
104	Varex Imaging Corp	2.744	0,53
		16.735	3,27
Medizinische Dienstleistungen – 3,22 % (28. Februar 2019: 2,71 %)			
587	AAC Holdings Inc	355	0,07
119	Acadia Healthcare Co Inc	3.142	0,61
26	Addus HomeCare Corp	2.312	0,45
179	Brookdale Senior Living Inc	1.464	0,29
775	Community Health Systems Inc	1.919	0,38
8	Fulgent Genetics Inc	87	0,02
161	RadNet Inc	2.242	0,44
147	Select Medical Holdings Corp	2.382	0,47
392	Surgery Partners Inc	2.531	0,49
		16.434	3,22
Wohnungsbauunternehmen – 5,17 % (28. Februar 2019: 3,47 %)			
362	Beazer Homes USA Inc	4.528	0,89
64	Century Communities Inc	1.792	0,35
56	LGI Homes Inc	4.558	0,89
105	M/I Homes Inc	3.785	0,74
107	MDC Holdings Inc	4.139	0,81
604	New Home Co Inc/The	2.247	0,44
148	TRI Pointe Group Inc	2.064	0,40
147	William Lyon Homes 'A'	2.602	0,51
22	Winnebago Industries Inc	694	0,14
		26.409	5,17
Einrichtungsgegenstände – 0,25 % (28. Februar 2019: 0,34 %)			
287	VOXX International Corp 'A'	1.268	0,25
Haushaltswaren und -artikel – 0,44 % (28. Februar 2019: 1,47 %)			
277	Libbey Inc	467	0,09
103	Quanex Building Products Corp	1.769	0,35
		2.236	0,44
Versicherungen – 2,63 % (28. Februar 2019: 2,00 %)			
54	HCI Group Inc	2.101	0,41
326	Heritage Insurance Holdings Inc	4.268	0,83
207	MBIA Inc	1.866	0,37
77	MGIC Investment Corp	967	0,19
38	NMI Holdings Inc 'A'	1.077	0,21
141	Radian Group Inc	3.180	0,62
		13.459	2,63
Internet – 2,14 % (28. Februar 2019: 0,89 %)			
161	comScore Inc	299	0,06
38	Eastside Distilling Inc	198	0,04
120	Eventbrite Inc	2.088	0,41
150	EverQuote Inc	3.357	0,66
26	Leaf Group Ltd	110	0,02
411	Limelight Networks Inc	996	0,19
85	PC-Tel Inc	578	0,11
325	Rubicon Project Inc/The	3.326	0,65
		10.952	2,14
Eisen/Stahl – 2,31 % (28. Februar 2019: 3,53 %)			
65	Allegheny Technologies Inc	1.293	0,25
47	Carpenter Technology Corp	2.298	0,45
353	Cleveland-Cliffs Inc	2.797	0,55

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Anteile (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien – (Fortsetzung)			
Eisen/Stahl – (Fortsetzung)			
175	Commercial Metals Co	2.746	0,53
171	Universal Stainless & Alloy Products Inc	2.698	0,53
		11.832	2,31
Unterkunft – 0,39 % (28. Februar 2019: 0,14 %)			
164	Century Casinos Inc	1.255	0,25
92	Playa Hotels & Resorts NV	742	0,14
		1.997	0,39
Maschinenbau - Bau und Bergbau – 1,69 % (28. Februar 2019: 1,49 %)			
121	Astec Industries Inc	3.353	0,66
362	Bloom Energy Corp	1.624	0,32
67	Hyster-Yale Materials Handling Inc	3.652	0,71
		8.629	1,69
Maschinenanlagen - diversifiziert – 2,55 % (28. Februar 2019: 2,83 %)			
136	Gencor Industries Inc	1.546	0,30
100	Ichor Holdings Ltd	2.115	0,42
439	Intevac Inc	2.145	0,42
250	Mueller Water Products Inc 'A'	2.610	0,51
284	NN Inc	1.825	0,36
282	Power Solutions International Inc	2.767	0,54
		13.008	2,55
Metallverarbeitung und -Hardware – 2,86 % (28. Februar 2019: 3,07 %)			
38	Mueller Industries Inc	1.001	0,20
200	Northwest Pipe Co	4.595	0,90
31	Park-Ohio Holdings Corp	833	0,16
255	Synalloy Corp	4.076	0,80
148	TimkenSteel Corp	773	0,15
113	TriMas Corp	3.334	0,65
		14.612	2,86
Bergbau – 0,49 % (28. Februar 2019: 0,58 %)			
305	Century Aluminum Co	1.681	0,33
621	Ferroglobe Plc	816	0,16
		2.497	0,49
Verschiedene verarbeitende Gewerbe – 1,99 % (28. Februar 2019: 2,98 %)			
53	Fabrinet	2.678	0,52
239	FreightCar America Inc	1.003	0,20
100	Haynes International Inc	2.988	0,58
28	LSB Industries Inc	130	0,03
84	Lydall Inc	1.688	0,33
97	Trinity Industries Inc	1.698	0,33
		10.185	1,99
Büro- und Geschäftsausstattung – 0,26 % 28. Februar 2019 0,31 %)			
372	Pitney Bowes Inc	1.318	0,26
Büroausstattung – 0,21 % (28. Februar 2019: 0,83 %)			
4	Herman Miller Inc	178	0,03
83	Interface Inc 'A'	914	0,18
		1.092	0,21
Öl und Gas – 1,84 % (28. Februar 2019: 2,28 %)			
537	Baytex Energy Corp	691	0,13
55	Bonanza Creek Energy Inc	1.240	0,24
234	Matador Resources Co	3.663	0,72
114	Talos Energy Inc	2.173	0,42
135	Trecora Resources	1.221	0,24
66	Whiting Petroleum Corp	437	0,09
		9.425	1,84
Öl- und Gasdienstleistungen – 2,60 % (28. Februar 2019: 2,77 %)			
224	Archrock Inc	2.173	0,42
555	Independence Contract Drilling Inc	580	0,11
125	KLX Energy Services Holdings Inc	1.254	0,25
587	Newpark Resources Inc	3.879	0,76
211	Patterson-UTI Energy Inc	1.825	0,36
266	Ranger Energy Services Inc	1.699	0,33
186	US Silica Holdings Inc	1.888	0,37
		13.298	2,60
Pharmaindustrie – 1,33 % (28. Februar 2019: 1,29 %)			
91	Flexion Therapeutics Inc	1.203	0,24
748	Option Care Health Inc	2.614	0,51
585	Owens & Minor Inc	2.973	0,58
		6.790	1,33
Immobilien – 0,20 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
210	Realogy Holdings Corp	1.004	0,20
Einzelhandel – 2,78 % (28. Februar 2019: 3,11 %)			
106	American Eagle Outfitters Inc	1.781	0,35
278	Aspen Aerogels Inc	1.673	0,33
417	Carrols Restaurant Group Inc	3.047	0,59
38	Conn's Inc	769	0,15
152	El Pollo Loco Holdings Inc	1.549	0,30
30	Kura Sushi USA Inc	754	0,15
272	Lumber Liquidators Holdings Inc	2.556	0,50
294	RTW RetailWinds Inc	293	0,06
586	Stage Stores Inc	451	0,09
177	Tuesday Morning Corp	248	0,05
42	Zumiez Inc	1.088	0,21
		14.209	2,78
Sparkassen – 0,18 % (28. Februar 2019: 0,18 %)			
35	Axos Financial Inc	908	0,18
Halbleiter – 7,47 % (28. Februar 2019: 6,83 %)			
530	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	6.237	1,22
203	Amkor Technology Inc	1.779	0,35
219	Amtech Systems Inc	1.114	0,22
445	AXT Inc	1.506	0,29
74	Brooks Automation Inc	2.483	0,49
122	Cohu Inc	1.453	0,28
71	Emcore Corp	203	0,04
239	FormFactor Inc	4.074	0,80
170	Kulicke & Soffa Industries Inc	3.553	0,70
266	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	5.225	1,02
81	Nanometrics Inc	2.221	0,43
139	Rudolph Technologies Inc	3.066	0,60
258	Ultra Clean Holdings Inc	3.084	0,60
237	Veeco Instruments Inc	2.198	0,43
		38.196	7,47
Software – 3,62 % (28. Februar 2019: 2,91 %)			
177	Allscripts Healthcare Solutions Inc	1.609	0,31
227	Asure Software Inc	1.466	0,29
287	Avaya Holdings Corp	4.051	0,79
478	Avid Technology Inc	3.567	0,70
615	Castlight Health Inc	870	0,17
101	Cloudera Inc	721	0,14
22	Ebix Inc	787	0,15
273	Evolent Health Inc 'A'	1.874	0,37
63	Tabula Rasa HealthCare Inc	3.558	0,70
		18.503	3,62
Telekommunikation – 4,43 % (28. Februar 2019 4,39 %)			
462	A10 Networks Inc	3.207	0,63
28	Aviat Networks Inc	391	0,08
123	CalAmp Corp	1.180	0,23
83	Ciena Corp	3.380	0,66
127	Digi International Inc	1.626	0,32
94	Extreme Networks Inc	631	0,12
118	Finisar Corp	2.658	0,52
196	Frequency Electronics Inc	2.088	0,41
284	Infinera Corp	1.510	0,29
68	Iridium Communications Inc	1.632	0,32
153	Ooma Inc	1.914	0,37
471	Ribbon Communications Inc	2.436	0,48
		22.653	4,43
Transportwesen – 4,15 % (28. Februar 2019: 3,86 %)			
253	Ardmore Shipping Corp	1.579	0,31
76	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	1.957	0,38
989	Celadon Group Inc	1.671	0,33
66	Diana Shipping Inc	222	0,04
450	Dorian LPG Ltd	4.677	0,92
275	Eagle Bulk Shipping Inc	1.263	0,25
159	GasLog Ltd	1.949	0,38
307	Navigator Holdings Ltd	2.881	0,56
251	Scorpio Bulkers Inc	1.590	0,31
44	StealthGas Inc	140	0,03
225	Teekay LNG Partners LP	3.270	0,64
		21.199	4,15
Speditions- und Leasinggeschäft – 0,10 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
64	General Finance Corp	524	0,10
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 579.547)		503.606	98,54
Immobilienfonds (REIT) – 0,58 % (28. Februar 2019: 0,11 %)			
REITs – 0,58 % (28. Februar 2019: 0,11 %)			
106	Armada Hoffler Properties Inc	1.839	0,36
116	CatchMark Timber Trust Inc 'A'	1.153	0,22
		2.992	0,58
Summe Immobilienfonds (REIT) (Anschaffungskosten USD 2.788)		2.992	0,58
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 589.490)		513.753	100,52
Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2019: 0,03 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		74	0,01
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		513.827	100,53
Devisenterminkontrakte – (0,13 %) (28. Februar 2019: (0,01 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(667)	(0,13)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		(667)	(0,13)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewerteteoder Verlust		513.160	100,40
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(2.087)	(0,40)
Gesamtnettovermögen		USD 511.073	100,00

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

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,39
Investmentfonds	1,39
Derivate	0,01
Sonstige Vermögenswerte	0,21
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	AUD	2	USD –
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.405	Verkauf	BRL	9.897	15
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	51	Verkauf	EUR	46	1

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	SGD	1	USD –
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	USD	–	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	BRL	9.898	Verkauf	USD	2.605	(216)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	1	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	95	Verkauf	USD	116	–
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	58	Verkauf	USD	42	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	SGD	6	–
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	71	Verkauf	USD	86	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1.565	Verkauf	AUD	2.313	8
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	49	Verkauf	CNH	352	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	42	Verkauf	CNH	294	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	4.502	Verkauf	EUR	4.049	48
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	17	Verkauf	GBP	14	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	35	Verkauf	GBP	29	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	70	Verkauf	PLN	276	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	7	Verkauf	SEK	58	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	305	Verkauf	SGD	426	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	34	Verkauf	SGD	47	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	14.048	Verkauf	USD	15.768	(317)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CNH	9.504	Verkauf	USD	1.344	(17)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	4.089	Verkauf	USD	1.059	(31)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	503	Verkauf	USD	53	(1)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	15	Verkauf	USD	18	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	171	Verkauf	USD	122	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	345	Verkauf	USD	232	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	5.079	Verkauf	USD	3.678	(17)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	440	Verkauf	USD	536	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	12.654	Verkauf	USD	8.584	(61)
01.10.19	BNY Mellon	Kauf	BRL	8.667	Verkauf	USD	2.095	(7)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 241)								74
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (80))								(667)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 161)								USD (593)

Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Investmentfonds – 3,80 % (28. Februar 2019: 5,50 %)			
11	iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.302	1,77
8	SPDR S&P 600 Small CapValue ETF – ETF	477	0,65
1.017	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (ausschüttend)	1.017	1,38
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 2.871)		2.796	3,80
Stammaktien – 97,08 % (28. Februar 2019: 94,74 %)			
Bekleidung – 1,35 % (28. Februar 2019: 0,96 %)			
38	Wolverine World Wide Inc	994	1,35
Automobilhersteller – 0,47 % (28. Februar 2019: 1,41 %)			
25	Wabash National Corp	344	0,47
Kfz-Teile und Zubehör – 4,07 % (28. Februar 2019: 4,59 %)			
101	Meritor Inc	1.693	2,30
18	Methode Electronics Inc	575	0,78
8	Standard Motor Products Inc	350	0,47
6	Visteon Corp	379	0,52
		2.997	4,07
Biotechnologie – 0,94 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
95	Pfenex Inc	693	0,94
Baustoffe – 5,29 % (28. Februar 2019: 5,08 %)			
20	Apogee Enterprises Inc	727	0,99
32	Gibraltar Industries Inc	1.284	1,74
20	Patrick Industries Inc	718	0,97
5	Simpson Manufacturing Co Inc	327	0,44
CAD 29	Stella-Jones Inc	844	1,15
		3.900	5,29
Chemie – 1,49 % (28. Februar 2019: 2,22 %)			
23	Minerals Technologies Inc	1.097	1,49
Gewerbliche Dienstleistungen – 3,04 % (28. Februar 2019: 2,20 %)			
12	AMN Healthcare Services Inc	677	0,92
45	Heidrick & Struggles International Inc	1.201	1,63
5	Monro Inc	365	0,49
		2.243	3,04
Computer – 2,85 % (28. Februar 2019: 1,47 %)			
34	Insight Enterprises Inc	1.615	2,19
22	NetScout Systems Inc	485	0,66
		2.100	2,85
Kosmetika & Körperpflege – 1,77 % (28. Februar 2019: 2,14 %)			
20	Inter Parfums Inc	1.301	1,77
Distribution und Großhandel – 1,01 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
36	G-III Apparel Group Ltd	741	1,01
Diversifiziert – Finanzdienstleistungen – 5,47 % (28. Februar 2019: 6,24 %)			
42	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	1.105	1,50
39	Houlihan Lokey Inc 'A'	1.718	2,33
35	Lazard Ltd 'A'	1.207	1,64
		4.030	5,47
Elektrische Komponenten und Zubehör – 1,82 % (28. Februar 2019: 1,93 %)			
12	EnerSys	689	0,93
51	nLight Inc	656	0,89
		1.345	1,82
Elektronik – 6,66 % (28. Februar 2019: 8,29 %)			
8	Advanced Energy Industries Inc	402	0,55
6	Coherent Inc	812	1,10
9	FARO Technologies Inc	420	0,57
16	Gentex Corp	418	0,57
73	Kimball Electronics Inc	966	1,31
12	Stoneridge Inc	362	0,49
38	Vishay Intertechnology Inc	593	0,80
30	Vishay Precision Group Inc	934	1,27
		4.907	6,66
Technik und Bau – 3,96 % (28. Februar 2019: 4,09 %)			
43	Arcosa Inc	1.406	1,91
8	Comfort Systems USA Inc	309	0,42
107	Sterling Construction Co Inc	1.201	1,63
		2.916	3,96
Lebensmittel – 3,23 % (28. Februar 2019: 2,12 %)			
15	Cal-Maine Foods Inc	591	0,80
17	Industrias Bachoco SAB de CV ADR	925	1,25
24	Tootsie Roll Industries Inc	867	1,18
		2.383	3,23
Hand- und Maschinenwerkzeuge – 1,60 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
17	Colfax Corp	465	0,63
24	Kennametal Inc	714	0,97
		1.179	1,60
Medizinische Produkte – 2,34 % (28. Februar 2019: 1,95 %)			
7	Bio-Techne Corp	1.336	1,81
18	Lantheus Holdings Inc	387	0,53
		1.723	2,34
Wohnungsbauunternehmen – 1,63 % (28. Februar 2019: 1,71 %)			
14	LCI Industries	1.200	1,63
Einrichtungsgegenstände – 0,39 % (28. Februar 2019: 0,59 %)			
17	Ethan Allen Interiors Inc	287	0,39
Versicherungen – 6,48 % (28. Februar 2019: 5,88 %)			
16	FBL Financial Group Inc	838	1,14
CAD 48	Genworth MI Canada Inc	1.834	2,49
20	ProAssurance Corp	793	1,07
14	RLI Corp	1.309	1,78
		4.774	6,48
Freizeit – 2,21 % (28. Februar 2019: 1,71 %)			
10	Johnson Outdoors Inc	548	0,74
71	MasterCraft Boat Holdings Inc	1.080	1,47
		1.628	2,21
Unterkunft – 1,45 % (28. Februar 2019: 1,08 %)			
139	Century Casinos Inc	1.068	1,45
Maschinenanlagen - diversifiziert – 1,69 % (28. Februar 2019: 1,77 %)			
15	Kadant Inc	1.243	1,69
Metallverarbeitung und -Hardware – 2,25 % (28. Februar 2019: 3,79 %)			
13	CIRCOR International Inc	440	0,60
7	Helios Technologies Inc	303	0,41
2	RBC Bearings Inc	335	0,45
4	Valmont Industries Inc	583	0,79
		1.661	2,25
Verschiedene verarbeitende Gewerbe – 2,44 % (28. Februar 2019: 2,27 %)			
13	Fabrinet	644	0,88
11	John Bean Technologies Corp	1.152	1,56
		1.796	2,44
Büroausstattung – 1,75 % (28. Februar 2019: 1,74 %)			
49	Kimball International Inc	866	1,18
27	Steelcase Inc	423	0,57
		1.289	1,75
Öl- und Gasdienstleistungen – 4,45 % (28. Februar 2019: 3,39 %)			
31	Oil States International Inc	422	0,57
CAD 126	Pason Systems Inc	1.490	2,03
NOK 57	TGS NOPEC Geophysical Co ASA	1.363	1,85
		3.275	4,45
Pharmaindustrie – 0,72 % (28. Februar 2019: 0,87 %)			
9	Eagle Pharmaceuticals Inc/DE	530	0,72
Private Equity – 2,48 % (28. Februar 2019: 2,43 %)			
87	Kennedy-Wilson Holdings Inc	1.825	2,48
Immobilien – 1,62 % (28. Februar 2019: 1,90 %)			
33	Marcus & Millichap Inc	1.197	1,62
Einzelhandel – 4,15 % (28. Februar 2019: 3,09 %)			
67	Caleres Inc	1.341	1,82
9	Children's Place Inc/The	750	1,02
39	Movado Group Inc	832	1,13
8	Regis Corp	131	0,18
		3.054	4,15
Halbleiter – 7,48 % (28. Februar 2019: 7,13 %)			
10	Cabot Microelectronics Corp	1.260	1,71
27	Cohu Inc	326	0,44
28	Kulicke & Soffa Industries Inc	575	0,78
20	MKS Instruments Inc	1.597	2,17
15	Nanometrics Inc	416	0,56
32	Nova Measuring Instruments Ltd	900	1,22
14	Silicon Motion Technology Corp ADR	439	0,60
		5.513	7,48
Software – 3,84 % (28. Februar 2019: 2,68 %)			
21	j2 Global Inc	1.770	2,40
29	Simulations Plus Inc	1.061	1,44
		2.831	3,84
Textilien – 1,13 % (28. Februar 2019: 1,59 %)			
4	UniFirst Corp/MA	831	1,13
Transportwesen – 3,07 % (28. Februar 2019: 2,79 %)			
14	Landstar System Inc	1.523	2,06
9	Saia Inc	743	1,01
		2.266	3,07
Wasser – 0,49 % (28. Februar 2019: 0,47 %)			
38	PICO Holdings Inc	363	0,49
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 73.181)		71.524	97,08
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 76.052)		74.320	100,88
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1	–
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		74.321	100,88
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(2)	–
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(2)	–
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verlust		74.319	100,88
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(644)	(0,88)
Nettovermögen insgesamt	USD	73.675	100,00

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

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt
ETF – Börsengehandelter Fonds (Exchange Traded Fund)
SPDR – Standard & Poor's Depository Receipts
CAD – Kanadischer Dollar
NOK – Norwegische Krone

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,05
Investmentfonds	3,75
Derivate	–
Sonstige Vermögenswerte	0,20
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)				Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)	
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	83	Verkauf		EUR	75	USD	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf		EUR	4		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf		SEK	20		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SEK	84	Verkauf		USD	9		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	65	Verkauf		USD	73		(2)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2)										1
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (2))										(2)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)									USD	(1)

Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) EUR	% des Nettoinventarwerts
Stammaktien – 99,60 % (28. Februar 2019: 96,23 %)			
Australien – 2,85 % (28. Februar 2019: 2,69 %)			
GBP 25	BHP Group Plc	492	1,12
GBP 16	Rio Tinto Plc	758	1,73
		1.250	2,85
Belgien – 0,82 % (28. Februar 2019: 0,78 %)			
8	Telenet Group Holding NV	361	0,82
Dänemark – 6,86 % (28. Februar 2019: 6,32 %)			
DKK 6	Coloplast A/S	670	1,52
DKK 28	Danske Bank A/S	338	0,77
DKK 14	H Lundbeck A/S	464	1,06
DKK 19	Novo Nordisk A/S	918	2,09
DKK 16	Pandora A/S	623	1,42
		3.013	6,86
Finnland – 7,33 % (28. Februar 2019: 6,30 %)			
13	Kesko Oyj	742	1,69
24	Neste OYJ	691	1,58
2	Nordea Bank Abp	10	0,02
16	Orion Oyj	532	1,21
18	Sampo Oyj 'A'	640	1,46
24	UPM-Kymmene Oyj	602	1,37
		3.217	7,33
Frankreich – 9,18 % (28. Februar 2019: 6,89 %)			
36	Eutelsat Communications SA	568	1,30
19	Neopost SA	344	0,78
5	Safran SA	594	1,35
10	Sanofi	787	1,79
17	SCOR SE	621	1,41
5	Sodexo SA	488	1,11
29	Veolia Environnement SA	630	1,44
		4.032	9,18
Deutschland – 14,78 % (28. Februar 2019: 13,48 %)			
4	Allianz SE	840	1,91
63	Aroundtown SA	477	1,09
36	Deutsche Telekom AG	551	1,25
5	Hannover Rueck SE	668	1,52
6	HOCHTIEF AG	549	1,25
4	LEG Immobilien AG	430	0,98
4	MAN SE	211	0,48
4	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	806	1,84
5	Siemens AG	480	1,09
24	TAG Immobilien AG	499	1,14
16	Talanx AG	597	1,36
166	Telefonica Deutschland Holding AG	382	0,87
		6.490	14,78
Italien – 3,97 % (28. Februar 2019: 2,50 %)			
101	Enel SpA	668	1,52
13	Recordati SpA	532	1,21
118	Snam SpA	543	1,24
		1.743	3,97
Luxemburg – 0,93 % (28. Februar 2019: 1,15 %)			
28	SES SA 'A'	406	0,93
Niederlande – 3,04 % (28. Februar 2019: 3,12 %)			
35	Koninklijke Ahold Delhaize NV	742	1,69
GBP 11	Royal Dutch Shell Plc	290	0,66
20	SBM Offshore NV	305	0,69
		1.337	3,04
Norwegen – 4,48 % (28. Februar 2019: 3,86 %)			
NOK 44	DNB ASA	647	1,47
NOK 26	Mowi ASA	575	1,31
NOK 40	Telenor ASA	744	1,70
		1.966	4,48
Portugal – 1,39 % (28. Februar 2019: 1,27 %)			
47	Galp Energia SGPS SA	612	1,39
Russland – 0,85 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
GBP 68	Evraz Plc	374	0,85
Spanien – 5,73 % (28. Februar 2019: 5,54 %)			
96	Bankinter SA	510	1,16
30	Enagas SA	587	1,34
32	Endesa SA	738	1,68
38	Red Electrica Corp SA	682	1,55
		2.517	5,73
Schweden – 5,23 % (28. Februar 2019: 6,67 %)			
SEK 17	ICA Gruppen AB	742	1,69
SEK 16	Intrum AB	376	0,86
SEK 83	Skandinaviska Enskilda Banken AB	651	1,48
SEK 15	Swedish Match AB	526	1,20
		2.295	5,23
Schweiz – 13,06 % (28. Februar 2019: 9,80 %)			
CHF 4	Baloise Holding AG	592	1,35
CHF 4	Flughafen Zurich AG	628	1,43
CHF 10	Nestle SA	1.024	2,33
CHF 10	Novartis AG	812	1,85
CHF 3	Roche Holding AG	862	1,97
CHF –	SGS SA	672	1,53
CHF 6	Swiss Prime Site AG	579	1,32
CHF 1	Swisscom AG	563	1,28
		5.732	13,06
Großbritannien – 19,10 % (28. Februar 2019: 25,86 %)			
GBP 130	BP Plc	719	1,64
GBP 15	British American Tobacco Plc	472	1,08
GBP 20	Bunzl Plc	448	1,02
GBP 301	Centrica Plc	233	0,53
GBP 18	Diageo Plc	691	1,58
GBP 191	Direct Line Insurance Group Plc	598	1,36
GBP 47	GlaxoSmithKline Plc	889	2,02
GBP 76	IG Group Holdings Plc	453	1,03
GBP 24	Imperial Brands Plc	574	1,31
GBP 843	Lloyds Banking Group Plc	467	1,06
GBP 20	Persimmon Plc	427	0,97
23	Royal Dutch Shell Plc 'A'	586	1,33
GBP 148	Royal Mail Plc	339	0,77
GBP 60	Tate & Lyle Plc	478	1,09
GBP 362	Taylor Wimpey Plc	587	1,34
GBP 40	WPP Plc	426	0,97
		8.387	19,10
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten EUR 48.085)		43.732	99,60
Immobilienfonds (REIT) – 2,60 % (28. Februar 2019: 2,47 %)			
Frankreich – 1,56 % (28. Februar 2019: 1,42 %)			
25	Klepierre SA	686	1,56
Großbritannien – 1,04 % (28. Februar 2019: 1,05 %)			
GBP 53	Land Securities Group Plc	454	1,04
Summe Immobilienfonds (REIT) (Anschaffungskosten EUR 1.598)		1.140	2,60
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten EUR 49.683)		44.872	102,20
Devisenterminkontrakte – 0,50 % (28. Februar 2019: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		220	0,50
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		45.092	102,70
Devisenterminkontrakte – (0,01 %) (28. Februar 2019: 0,11 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(3)	(0,01)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		(3)	(0,01)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten		45.089	102,69
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(1.181)	(2,69)
Nettovermögen insgesamt	EUR	43.908	100,00

– Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf EUR 0 oder weniger als EUR 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

ABKÜRZUNGEN:

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

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,55
Derivate	0,48
Sonstige Vermögenswerte	1,97
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–	EUR –
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2.097	Verkauf	EUR	1.900	9
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	78	Verkauf	AUD	129	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	CNH	4	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	9.623	Verkauf	EUR	8.568	179
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	480	Verkauf	EUR	307	5
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	301	Verkauf	EUR	70	(1)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CNH	785	Verkauf	EUR	99	1
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	3.255	Verkauf	EUR	1.969	26
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	25	Verkauf	SGD	38	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	175	Verkauf	USD	194	(2)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR 5)								220
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR (58))								(3)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR (53))								EUR 217

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Anteile (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Stammaktien – 93,37 % (28. Februar 2019: 94,39 %)				
Australien – 7,90 % (28. Februar 2019: 6,86 %)				
AUD	309	Aurizon Holdings Ltd	1.227	1,63
AUD	38	Brickworks Ltd	411	0,54
AUD	29	Caltex Australia Ltd	464	0,62
AUD	150	Coca-Cola Amatil Ltd	1.096	1,46
AUD	7	Commonwealth Bank of Australia	397	0,53
AUD	263	Inghams Group Ltd	561	0,74
AUD	50	McMillan Shakespeare Ltd	536	0,71
AUD	26	National Australia Bank Ltd	487	0,65
AUD	242	Orora Ltd	455	0,60
AUD	126	Telstra Corp Ltd	316	0,42
			5.950	7,90
China – 24,79 % (28. Februar 2019: 23,98 %)				
HKD	1.341	Agricultural Bank of China Ltd	515	0,68
HKD	3.000	CGN Power Co Ltd, 144A	789	1,05
HKD	872	China Aircraft Leasing Group Holdings Ltd	919	1,22
HKD	1.156	China Communications Services Corp Ltd	646	0,86
HKD	1.504	China Construction Bank Corp	1.117	1,48
HKD	127	China Pacific Insurance Group Co Ltd	508	0,67
HKD	1.264	China Petroleum & Chemical Corp	738	0,98
HKD	1.153	China Railway Group Ltd	752	1,00
HKD	178	China Resources Gas Group Ltd	876	1,16
HKD	319	China Shenhua Energy Co Ltd	625	0,83
HKD	1.846	China Telecom Corp Ltd	824	1,09
HKD	218	China Vanke Co Ltd	750	1,00
HKD	702	CITIC Ltd	831	1,10
HKD	2.348	CITIC Telecom International Holdings Ltd	916	1,22
HKD	1.295	Dali Foods Group Co Ltd, 144A	860	1,14
HKD	390	Guangdong Investment Ltd	820	1,09
HKD	120	Hengan International Group Co Ltd	789	1,05
HKD	1.497	Huaneng Power International Inc	823	1,09
HKD	1.912	Maanshan Iron & Steel Co Ltd	714	0,95
HKD	752	Shenzhen Expressway Co Ltd	920	1,22
HKD	789	Sinopec Engineering Group Co Ltd	514	0,68
HKD	13	Tencent Holdings Ltd	524	0,70
HKD	966	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	750	1,00
HKD	1.338	Yuzhou Properties Co Ltd	562	0,75
HKD	1.566	Zijin Mining Group Co Ltd	584	0,78
			18.666	24,79
Hongkong – 7,00 % (28. Februar 2019: 10,65 %)				
HKD	70	CK Hutchison Holdings Ltd	608	0,81
HKD	68	CLP Holdings Ltd	700	0,93
HKD	1.612	Giordano International Ltd	503	0,67
HKD	490	HKT Trust & HKT Ltd	765	1,02
	978	Hutchison Port Holdings Trust	153	0,20
HKD	127	Hysan Development Co Ltd	514	0,68
HKD	315	Lifestyle International Holdings Ltd	352	0,47
HKD	70	SmarTone Telecommunications Holdings Ltd	62	0,08
HKD	252	Swire Properties Ltd	825	1,09
HKD	54	VTech Holdings Ltd	427	0,57
HKD	141	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	359	0,48
			5.268	7,00
Indien – 8,43 % (28. Februar 2019: 5,83 %)				
INR	250	Coal India Ltd	647	0,86
INR	25	Dr Reddy's Laboratories Ltd	916	1,21
INR	600	Firstsource Solutions Ltd	405	0,54
INR	52	HCL Technologies Ltd	804	1,07
INR	139	Infosys Ltd	1.582	2,10
INR	1.873	NHPC Ltd	615	0,82
INR	38	Tata Consultancy Services Ltd	1.193	1,58
INR	96	Vedanta Ltd	188	0,25
			6.350	8,43
Indonesien – 2,70 % (28. Februar 2019: 2,66 %)				
IDR	1.598	Adaro Energy Tbk PT	126	0,17
IDR	507	Indo Tambangraya Megah Tbk PT	463	0,62
IDR	1.194	Indofood Sukses Makmur Tbk PT	665	0,88
IDR	2.470	Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	776	1,03
			2.030	2,70
Macau – 1,05 % (28. Februar 2019: 1,00 %)				
HKD	174	Sands China Ltd	787	1,05
Malaysia – 4,56 % (28. Februar 2019: 4,03 %)				
MYR	2.180	Astro Malaysia Holdings Bhd †	681	0,90
MYR	1.300	Bermaz Auto Bhd	707	0,94
MYR	342	Bursa Malaysia Bhd	508	0,68
MYR	465	MISC Bhd	800	1,06
MYR	153	Public Bank Bhd	735	0,98
			3.431	4,56
Neuseeland – 2,78 % (28. Februar 2019: 4,20 %)				
NZD	365	Air New Zealand Ltd	657	0,87
NZD	141	Contact Energy Ltd	738	0,98
NZD	176	Z Energy Ltd	698	0,93
			2.093	2,78
Pakistan – 0,46 % (28. Februar 2019: 0,55 %)				
PKR	324	MCB Bank Ltd	349	0,46
Philippinen – 1,23 % (28. Februar 2019: 0,99 %)				
PHP	1.277	Aboitiz Power Corp	930	1,23
Südkorea – 10,44 % (28. Februar 2019: 11,86 %)				
KRW	2	Binggrae Co Ltd	77	0,10
KRW	10	DB Insurance Co Ltd	377	0,50
KRW	16	GS Retail Co Ltd	519	0,69
KRW	6	Hansol Paper Co Ltd	79	0,10
KRW	6	Hyundai Department Store Co Ltd	404	0,54
	66	KT Corp ADR	741	0,98
KRW	11	KT&G Corp	909	1,21
KRW	69	LG Uplus Corp	757	1,01
KRW	90	Samsung Electronics Co Ltd	3.275	4,35
KRW	4	SK Telecom Co Ltd	720	0,96
			7.858	10,44
Taiwan – 13,22 % (28. Februar 2019: 12,27 %)				
TWD	561	Asia Cement Corp	767	1,02
TWD	100	Bioteque Corp	426	0,57
TWD	375	Chin-Poon Industrial Co Ltd	381	0,51
TWD	619	Coretronic Corp	757	1,01
TWD	1.522	CTBC Financial Holding Co Ltd	985	1,31
TWD	155	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	361	0,48
TWD	691	First Financial Holding Co Ltd	472	0,63
TWD	423	Lite-On Technology Corp	672	0,89
TWD	577	Mega Financial Holding Co Ltd	527	0,70
TWD	61	Phison Electronics Corp	561	0,74
TWD	60	President Chain Store Corp	557	0,74
TWD	297	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.441	3,24
TWD	428	Uni-President Enterprises Corp	1.042	1,38
			9.949	13,22
Thailand – 8,81 % (28. Februar 2019: 8,22 %)				
THB	387	CP ALL PCL, NVDR	1.058	1,41
THB	898	GFPT PCL, NVDR	529	0,70
THB	1.924	Home Product Center PCL, NVDR	1.128	1,50
THB	2.173	Land & Houses PCL, NVDR	762	1,01
THB	324	Major Cineplex Group PCL	271	0,36
THB	1.000	Pruksa Holding PCL, NVDR	632	0,84
THB	268	PTT Global Chemical PCL, NVDR	467	0,62
THB	13	Siam Cement PCL/The, NVDR	181	0,24
THB	158	Tisco Financial Group PCL, NVDR	526	0,70
THB	2.370	TTW PCL, NVDR	1.080	1,43
			6.634	8,81
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 73.759)			70.295	93,37
Immobilienfonds (REIT) – 6,86 % (28. Februar 2019: 3,54 %)				
Hongkong – 1,49 % (28. Februar 2019: 1,31 %)				
HKD	100	Link REIT	1.121	1,49
Singapur – 5,37 % (28. Februar 2019: 2,23 %)				
SGD	501	Ascott Residence Trust	467	0,62
SGD	700	CapitaLand Retail China Trust	784	1,04
SGD	964	First Real Estate Investment Trust	692	0,92
HKD	305	Fortune Real Estate Investment Trust	348	0,46
SGD	522	Mapletree Commercial Trust	855	1,13
SGD	542	Mapletree Industrial Trust	900	1,20
			4.046	5,37
Immobilienfonds (REIT) insgesamt (Anschaffungskosten USD 4.417)			5.167	6,86
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 78.176)			75.462	100,23
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019: 0,12 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			4	–
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte			75.466	100,23
Devisenterminkontrakte – (0,30 %) (28. Februar 2019: (0,01 %))				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(229)	(0,30)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten			(229)	(0,30)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			75.237	99,93
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			49	0,07
Nettovermögen insgesamt		USD	75.286	100,00

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

144A Von der Registrierung 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 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.649.000 USD und machten 2,19 % des Nettovermögens aus.

† Illiquide.

ABKÜRZUNGEN:

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

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,13
Derivate	0,01
Sonstige Vermögenswerte	0,86
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) aus Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	HKD	242	Verkauf	USD	31	USD	–
05.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	59	Verkauf	USD	39		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	80	Verkauf	AUD	118		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	498	Verkauf	AUD	735		4
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	CNH	8		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	SGD	3		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	26.193	Verkauf	USD	18.973		(98)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	PLN	10.625	Verkauf	USD	2.757		(87)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	CNH	2.267	Verkauf	USD	321		(4)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	8.022	Verkauf	USD	5.444		(40)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 99)									4
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (8))									(229)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 91)								USD	(225)

Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)		wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Investmentfonds – 1,87 % (28. Februar 2019: 0,00 %)			
3	iShares MSCI ACWI ETF – ETF	243	1,87
Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten USD 240)		243	1,87
Stammaktien – 89,28 % (28. Februar 2019: 92,86 %)			
Australien – 4,19 % (28. Februar 2019: 3,84 %)			
AUD 46	Aurizon Holdings Ltd	185	1,42
AUD 39	Qantas Airways Ltd	160	1,24
GBP 2	Rio Tinto Plc	117	0,90
AUD 33	Telstra Corp Ltd	82	0,63
		544	4,19
Österreich – 0,98 % (28. Februar 2019: 1,05 %)			
EUR 4	Oesterreichische Post AG	127	0,98
Kanada – 3,91 % (28. Februar 2019: 3,91 %)			
CAD 2	Canadian Imperial Bank of Commerce	140	1,07
CAD 2	Genworth MI Canada Inc	83	0,64
CAD 3	National Bank of Canada	117	0,90
CAD 3	Toronto-Dominion Bank/The	168	1,30
		508	3,91
China – 2,82 % (28. Februar 2019: 2,60 %)			
HKD 234	China Petroleum & Chemical Corp	136	1,05
1	CNOOC Ltd ADR	104	0,80
HKD 78	Huaneng Power International Inc	43	0,33
HKD 222	Huishang Bank Corp Ltd	83	0,64
		366	2,82
Frankreich – 2,58 % (28. Februar 2019: 2,62 %)			
EUR 2	Sanofi	180	1,39
EUR 4	SCOR SE	155	1,19
		335	2,58
Deutschland – 2,60 % (28. Februar 2019: 2,43 %)			
EUR 1	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	190	1,46
EUR 4	Talanx AG	148	1,14
		338	2,60
Griechenland – 1,30 % (28. Februar 2019: 1,25 %)			
EUR 7	Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA	169	1,30
Hongkong – 1,99 % (28. Februar 2019: 3,30 %)			
HKD 129	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	109	0,84
HKD 276	PCCW Ltd	150	1,15
		259	1,99
Italien – 1,53 % (28. Februar 2019: 1,55 %)			
EUR 9	Assicurazioni Generali SpA	158	1,22
EUR 8	Snam SpA	41	0,31
		199	1,53
Japan – 6,82 % (28. Februar 2019: 5,37 %)			
JPY 1	Daito Trust Construction Co Ltd	64	0,49
JPY 12	Itochu Techno-Solutions Corp	331	2,54
JPY 31	Marubeni Corp	200	1,54
JPY 20	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	134	1,03
JPY 3	Nippon Telegraph & Telephone Corp	158	1,22
		887	6,82
Malaysia – 0,35 % (28. Februar 2019: 0,94 %)			
MYR 145	Astro Malaysia Holdings Bhd †	45	0,35
Mexiko – 1,41 % (28. Februar 2019: 1,25 %)			
MXN 65	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	183	1,41
Neuseeland – 5,81 % (28. Februar 2019: 6,37 %)			
NZD 72	Air New Zealand Ltd	129	0,99
NZD 98	Genesis Energy Ltd	211	1,62
NZD 84	Meridian Energy Ltd	263	2,03
NZD 43	SKY Network Television Ltd	30	0,23
NZD 31	Z Energy Ltd	122	0,94
		755	5,81
Norwegen – 2,83 % (28. Februar 2019: 2,99 %)			
NOK 16	Austevoll Seafood ASA	164	1,26
NOK 4	Salmar ASA	204	1,57
		368	2,83
Russland – 1,01 % (28. Februar 2019: 0,67 %)			
19	Gazprom PJSC ADR	132	1,01
Singapur – 2,51 % (28. Februar 2019: 2,74 %)			
SGD 36	ComfortDelGro Corp Ltd	64	0,49
SGD 36	SATS Ltd	126	0,97
SGD 13	Venture Corp Ltd	137	1,05
		327	2,51
Südafrika – 0,44 % (28. Februar 2019: 0,58 %)			
ZAR 4	Nedbank Group Ltd	57	0,44
Südkorea – 0,46 % (28. Februar 2019: 0,64 %)			
KRW 20	Tongyang Life Insurance Co Ltd	60	0,46
Spanien – 2,78 % (28. Februar 2019: 2,96 %)			
EUR 4	Enagas SA	98	0,75
EUR 7	Endesa SA	170	1,31
EUR 5	Red Electrica Corp SA	93	0,72
		361	2,78
Schweden – 1,24 % (28. Februar 2019: 1,50 %)			
SEK 14	Skandinaviska Enskilda Banken AB	123	0,94
SEK 3	Swedbank AB	38	0,30
		161	1,24
Schweiz – 2,57 % (28. Februar 2019: 2,55 %)			
CHF 1	Roche Holding AG	191	1,47
CHF 1	Swiss Re AG	144	1,10
		335	2,57
Taiwan – 7,01 % (28. Februar 2019: 7,73 %)			
TWD 309	AU Optronics Corp	80	0,62
TWD 57	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	133	1,02
TWD 381	Innolux Corp	85	0,65
TWD 172	King Yuan Electronics Co Ltd	187	1,44
TWD 90	Radiant Opto-Electronics Corp	326	2,51
TWD 12	Simplo Technology Co Ltd	100	0,77
		911	7,01
Türkei – 1,04 % (28. Februar 2019: 1,48 %)			
TRY 74	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	81	0,62
TRY 13	TAV Havalimanlari Holding AS	54	0,42
		135	1,04
Großbritannien – 8,18 % (28. Februar 2019: 9,76 %)			
GBP 20	Barratt Developments Plc	153	1,18
GBP 19	BP Plc	113	0,87
GBP 35	Direct Line Insurance Group Plc	120	0,92
GBP 10	GlaxoSmithKline Plc	211	1,63
GBP 5	Imperial Brands Plc	127	0,97
GBP 17	Legal & General Group Plc	45	0,34
GBP 4	Persimmon Plc	89	0,69
GBP 35	Royal Mail Plc	88	0,68
GBP 66	Taylor Wimpey Plc	117	0,90
		1.063	8,18
USA – 22,92 % (28. Februar 2019: 22,01 %)			
2	AbbVie Inc	149	1,15
2	Altria Group Inc	107	0,82
1	Amgen Inc	163	1,26
4	AT&T Inc	130	1,00
2	Brinker International Inc	93	0,72
2	Cisco Systems Inc	103	0,79
4	CNA Financial Corp	176	1,35
2	CVS Health Corp	148	1,14
11	Ford Motor Co	98	0,76
4	Gap Inc/The	59	0,45
2	Gilead Sciences Inc	147	1,13
7	H&R Block Inc	165	1,27
3	Kohl's Corp	121	0,93
1	Lockheed Martin Corp	232	1,79
6	Pfizer Inc	198	1,52
2	Southern Co/The	139	1,07
2	Target Corp	190	1,46
1	UGI Corp	42	0,32
3	Valero Energy Corp	224	1,72
3	WALMART INC	295	2,27
		2.979	22,92
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 11.012)		11.604	89,28
Immobilienfonds (REIT) – 7,65 % (28. Februar 2019: 7,18 %)			
Australien – 0,46 % (28. Februar 2019: 0,37 %)			
AUD 20	Stockland	61	0,46
Singapur – 3,12 % (28. Februar 2019: 2,61 %)			
SGD 102	Mapletree Commercial Trust	166	1,28
SGD 212	Mapletree Logistics Trust	239	1,84
		405	3,12
USA – 4,07 % (28. Februar 2019: 4,20 %)			
4	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A'	139	1,07
11	Kimco Realty Corp	202	1,56
8	Starwood Property Trust Inc	188	1,44
		529	4,07
Summe Immobilienfonds (REIT) (Anschaffungskosten USD 774)		995	7,65
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 12.026)		12.842	98,80
Devisenterminkontrakte – 0,21 % (28. Februar 2019: 0,08 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		26	0,21
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		12.868	99,01
Devisenterminkontrakte – (0,06 %) (28. Februar 2019: (0,17 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(7)	(0,06)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		(7)	(0,06)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten		12.861	98,95
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		137	1,05
Gesamtnettovermögen		USD 12.998	100,00

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

† Illiquide.

ABKÜRZUNGEN:

ADR	–	American Depositary Receipt
ETF	–	Börsengehandelter Fonds (Exchange Traded Fund)
AUD	–	Australischer Dollar
CAD	–	Kanadischer Dollar
CHF	–	Schweizer Franken
EUR	–	Euro
GBP	–	Britisches Pfund
HKD	–	Hongkong-Dollar
JPY	–	Japanischer Yen
KRW	–	Südkoreanischer Won
MXN	–	Mexikanischer Peso
MYR	–	Malaysischer Ringgit
NOK	–	Norwegische Krone
NZD	–	Neuseeländischer Dollar
SEK	–	Schwedische Krone
SGD	–	Singapur-Dollar
TRY	–	Türkische Lira
TWD	–	Taiwanesischer Dollar
ZAR	–	Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,37
Investmentfonds	1,86
Derivate	0,20
Sonstige Vermögenswerte	1,57
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)				Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	AUD	5	USD	–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	12	Verkauf	USD	9		–
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.471	Verkauf	USD	998		(7)
20.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	937	Verkauf	GBP	769		–
20.09.19	Citi	Kauf	USD	402	Verkauf	CAD	535		–
20.09.19	Northern Trust	Kauf	USD	1.231	Verkauf	EUR	1.106		14
20.09.19	Northern Trust	Kauf	USD	599	Verkauf	NZD	932		11
20.09.19	UBS	Kauf	USD	575	Verkauf	SGD	796		1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 11)									26
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (23))									(7)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD (12))								USD	19

Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)			wert (in Tsd.) USD	% des Nettovermögenswert
Stammaktien – 93,55 % (28. Februar 2019: 99,54 %)				
China – 30,42 % (28. Februar 2019: 29,43 %)				
HKD	979	China Mobile Ltd	8.117	3,33
HKD	1.001	ENN Energy Holdings Ltd	11.437	4,69
HKD	5.608	Guangdong Investment Ltd	11.815	4,84
HKD	1.402	AIA Group Ltd	4.265	1,75
HKD	1.208	Ping An Insurance Group Co, Class H		
		Sands China Ltd	13.888	5,70
HKD	435	Tencent Holdings Ltd	18.072	7,41
HKD	3.270	Travelsky Technology Ltd	6.581	2,70
			74.175	30,42
Hongkong – 11,31 % (28. Februar 2019: 14,50 %)				
HKD	1.697	AIA Group Ltd	16.549	6,79
	359	Molkereifarm International SK Holdings Co Ltd	2.562	1,05
	157	Jardine Matheson Holdings Ltd Ltd	8.457	3,47
			27.568	11,31
Indien – 18,46 % (28. Februar 2019: 19,89 %)				
INR	272	HDFC Bank Ltd	8.505	3,49
	39	ICICI Bank Ltd, ADR	4.168	1,71
INR	253	Hero MotoCorp Ltd	9.057	3,71
	1.077	Infosys Ltd, ADR	12.311	5,05
INR	347	Tata Consultancy Services Ltd	10.972	4,50
			45.013	18,46
Malaysia – 1,15 % (28. Februar 2019: 3,00 %)				
MYR	1.964	Genting Bhd	2.802	1,15
Singapur – 9,03 % (28. Februar 2019: 8,90 %)				
SGD	3.958	Singapore Technologies Engineering Ltd	11.224	4,61
SGD	599	United Overseas Bank Ltd	10.783	4,42
			22.007	9,03

Anteile (in Tsd.)			wert (in Tsd.) USD	% des Nettovermögenswert
Südkorea – 9,83 % (28. Februar 2019: 11,38 %)				
KRW	7	LG Household & Health Care Ltd.	6.537	2,68
KRW	198	Samsung Electronics Co Ltd	7.218	2,96
KRW	147	Woongjin Coway Co Ltd	10.209	4,19
			23.964	9,83
Taiwan – 5,71 % (28. Februar 2019: 2,59 %)				
TWD	1.681	Taiwan Semiconductor Murata Manufacturing Co Ltd	13.913	5,71
Thailand – 2,79 % (28. Februar 2019: 3,53 %)				
THB	1.683	Siam Commercial Bank PCL/ Die ∞	6.810	2,79
Großbritannien – 4,85 % (28. Februar 2019: 5,15 %)				
HKD	1.645	HSBC Holdings Plc	11.838	4,85
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 2.940)			228.090	93,55
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 147.808)			228.090	93,55
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte			228.090	93,55
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019 0,00 %)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			-	-
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte			-	-
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten			228.090	93,55
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			15.727	6,45
Nettovermögen insgesamt		USD	243.817	100,00

- Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

∞ Das Wertpapier wurde vom Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet. Ermessen des Investment Managers.

ABKÜRZUNGEN:

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

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,43
Sonstige Vermögenswerte	6,57
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
04.09.2019	BNY Mellon	Kauf	GBP	-	Verkauf	USD	-	USD	-
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)									-
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)									-
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)								USD	-

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
Stammaktien – 96,35 % (28. Februar 2019: 98,96 %)				
Bekleidung – 2,04 % (28. Februar 2019: 1,90 %)				
HKD	24	Shenzhou International Group SK Holdings Co Ltd	327	2,04
Kfz-Teile und Zubehör – 1,40 % 28. Februar 2019 0,83 %)				
HKD	74	AIA Group Ltd	225	1,40
Banken – 6,48 % (28. Februar 2019: 9,37 %)				
HKD	634	China Development Bank Corp	470	2,93
HKD	56	China Merchants Bank Co Ltd	253	1,58
HKD	501	Industrial & Commercial Bank of China Ltd, Class H	317	1,97
			1.040	6,48
Getränke – 1,87 % (28. Februar 2019: 1,53 %)				
HKD	20	Vitasoy International Holdings Ltd	93	0,58
CNH	10	Wuliangye Yibin Co Ltd	207	1,29
			300	1,87
Biotechnologie – 0,53 % (28. Februar 2019: 1,62 %)				
HKD	27	Innovent Biologics Inc, 144A	86	0,53
Gewerbliche Dienstleistungen – 3,89 % (28. Februar 2019 3,07 %)				
HKD	79	China Conch Venture Holdings Ltd	262	1,63
	3	Neues Orientalisches Bildungswesen & Technologiegruppe Inc. ADR	363	2,26
			625	3,89
Computer – 0,52 % (28. Februar 2019: 0,66 %)				
TWD	12	Ennoconn Corp	84	0,52
Diversifiziert – Finanzdienstleistungen – 4,52 % (28. Februar 2019 5,66 %)				
TWD	453	Cathay Financial Holding Co Ltd	365	2,27
HKD	12	Hongkong-Dollar Clearing Ltd	362	2,25
			727	4,52
Elektronik – 2,97 % (28. Februar 2019: 2,19 %)				
CNY	89	Luxshare Precision Industry Co Ltd	306	1,90
CNH	9	Shennan Circuits Co Ltd	172	1,07
			478	2,97
Alternative Energiequellen – 1,05 % (28. Februar 2019 0,00 %)				
CNH	43	Longi Green Energy GLOBALWAFERS CO LTD	168	1,05
Lebensmittel – 2,82 % (28. Februar 2019: 2,36 %)				
CNH	28	Foshan Haitian Aroma & Lebensmittel-Co	453	2,82
Gas – 1,42 % (28. Februar 2019: 1,30 %)				
HKD	20	ENN Energy Holdings Ltd	227	1,42
Medizinische Dienstleistungen – 1,91 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
HKD	29	Wuxi Biologics Cayman Inc., 144A	306	1,91
Holdinggesellschaften – diversifiziert – 1,56 % 28. Februar 2019 1,94 %)				
HKD	29	Ck Asset Holdings Ltd	251	1,56
Einrichtungsgegenstände – 1,14 % (28. Februar 2019: 1,11 %)				
CNH	25	Midea Group Co Ltd	183	1,14
Versicherungen – 10,38 % (28. Februar 2019: 10,99 %)				
HKD	101	AIA Group Ltd	983	6,12
HKD	71	China Life Insurance Co Ltd	166	1,04
HKD	45	Ping An Insurance Group Co, Class H China Ltd	518	3,22
			1.667	10,38
Internet – 21,87 % (28. Februar 2019: 21,09 %)				
	8	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.434	8,93
	1	Baidu, Inc., ADR	103	0,64
	6	Ctrip.com International Ltd, ADR	199	1,24
	11	Pinduo Inc. ADR	375	2,34
HKD	30	Tencent Holdings Ltd	1.225	7,63
	21	Vipshop Holdings Ltd ADR	176	1,09
			3.512	21,87
Verschiedene verarbeitende Gewerbe – 1,72 % (28. Februar 2019 1,71 %)				
TWD	1	Largan Precision Co Ltd	125	0,77
HKD	11	Sunny Optical Technology GLOBALWAFERS CO LTD	152	0,95
			277	1,72
Öl und Gas – 1,68 % (28. Februar 2019: 1,97 %)				
HKD	181	CNOOC Ltd	270	1,68
Öl- und Gasdienstleistungen – 0,30 % (28. Februar 2019: 0,47 %)				
HKD	84	CIMC Enric Holdings Ltd	49	0,30
Pharmaindustrie – 4,17 % (28. Februar 2019: 4,53 %)				
HKD	130	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	261	1,62
CNY	27	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd	302	1,88
HKD	22	Yichang HEC Changjiang Pharmaceutical Co Ltd, 144A	107	0,67
			670	4,17
Immobilien – 2,62 % (28. Februar 2019: 2,95 %)				
HKD	192	Kaisa Group Holdings Ltd	246	1,53
HKD	26	Ck Asset Holdings Ltd	175	1,09
			421	2,62
Halbleiter – 13,82 % (28. Februar 2019: 10,30 %)				
TWD	223	Macronix International	197	1,22
TWD	22	Mediatek Inc	258	1,61
TWD	166	Taiwan Semiconductor Murata Manufacturing Co Ltd	1.374	8,55
TWD	47	Win Semiconductors Corp	391	2,44
			2.220	13,82
Software – 1,92 % (28. Februar 2019: 1,41 %)				
	1	NetEase Inc. ADR	308	1,92
Telekommunikation – 1,16 % (28. Februar 2019 4,79 %)				
HKD	17	China Mobile Ltd	137	0,85
HKD	45	Xiaomi Corp 'B', 144A	49	0,31
			186	1,16
Transportwesen – 0,96 % (28. Februar 2019: 0,91 %)				
HKD	148	SITC International Holdings Co Ltd	154	0,96
Rumänien – 1,63 % (28. Februar 2019: 1,99 %)				
HKD	124	Guangdong Investment Ltd	261	1,63
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 12.628)			15.475	96,35
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte			15.475	96,35
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verlust			15.475	96,35
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			586	3,65
Nettovermögen insgesamt		USD	16.061	100,00

– Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf USD 0 oder weniger als USD 1.000, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Registrierung befreite Wertpapiere gemäß Regel 144A von Das Securities Act von 1933 in der geänderten Fassung. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2018 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 27.954.000 und machten 3,42 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt
CNY – Chinesischer Renminbi
CNH – Chinesischer Renminbi
HKD – Hongkong-Dollar
TWD – Taiwanesischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,02
Sonstige Vermögenswerte	3,98
Gesamtvermögen	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2013

Anteile (in Tsd.)			wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventarwerts
Stammaktien – 94,81 % (28. Februar 2019: 98,20 %)				
Australien – 2,76 % (28. Februar 2019: 2,42 %)				
AUD	4	PPC Ltd	722	2,76
Kanada – 3,27 % (28. Februar 2019: 2,63 %)				
CAD	9	Canadian National Railway Co	858	3,27
China – 3,35 % (28. Februar 2019: 3,56 %)				
HKD	21	Tencent Holdings Ltd	877	3,35
Denmark – 3,31 % (28. Februar 2019: 2,83 %)				
NZD	7	Coloplast A/S	867	3,31
Frankreich – 2,61 % (28. Februar 2019: 2,44 %)				
EUR	2	L'Oreal SA	683	2,61
Hongkong – 4,24 % (28. Februar 2019: 4,49 %)				
HKD	114	AIA Group Ltd	1.109	4,24
Irland – 2,86 % (28. Februar 2019: 2,56 %)				
EUR	6	Pennon Group PLC	749	2,86
Israel – 2,68 % (28. Februar 2019: 3,13 %)				
	6	Check Point Software Technologies Technologies Ltd	701	2,68
Spanien – 2,75 % (28. Februar 2019: 2,76 %)				
EUR	23	Industria de Diseno Textil SA	720	2,75
Schweden – 9,09 % (28. Februar 2019: 6,10 %)				
SEK	37	ASSA Abloy ab	777	2,97
SEK	29	Atlas Copco ab	863	3,30
SEK	17	Sechskant ab	740	2,82
			2.380	9,09
Schweiz – 4,10 % (28. Februar 2019: 7,20 %)				
NZD	1	Straumann Holding AG	1.075	4,10
Taiwan – 3,41 % (28. Februar 2019: 3,32 %)				
TWD	108	Taiwan Semiconductor Murata Manufacturing Co Ltd	894	3,41
Großbritannien – 14,31 % (28. Februar 2019: 19,88 %)				
GBP	27	Pennon Group PLC	684	2,61
	5	Linde Plc	888	3,39
GBP	9	Spirax-Sarco Engineering Plc	873	3,34
EUR	21	Unilever NV	1.301	4,97
			3.746	14,31

Anteile (in Tsd.)			wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventarwerts
USA – 36,07 % (28. Februar 2019: 34,88 %)				
	4	Accenture Plc	856	3,27
	2	ALIGN TECHNOLOGY INC	429	1,64
	7	Automatic Data Processing Inc	1.139	4,35
	6	Masimo Corp	997	3,81
	4	Mastercard Inc	1.061	4,05
	8	Microsoft Corp	1.092	4,17
	9	Nike Inc	782	2,99
	7	ReMed. Inc	986	3,76
	12	Starbucks Corp	1.167	4,46
	4	Waters Corp	936	3,57
			9.445	36,07
Vorzugsaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 20.171)			24.826	94,81
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 20.171)			24.826	94,81
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019 0,01 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			–	–
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten			24.826	94,81
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2019 0,00 %)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			–	–
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte			–	–
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewerteter finanzieller Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verlust			24.826	94,81
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			1.358	5,19
Gesamtnettovermögen			USD 26.184	100,00

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

ABKÜRZUNGEN:

AUD – Australischer Dollar
CAD – Kanadischer Dollar
CHF – Schweizer Franken
DKK – Dänische Krone
EUR – Euro
GBP – Britisches Pfund
HKD – Hongkong-Dollar
SEK – Schwedische Krone
TWD – Taiwanesischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,63
Derivate	-
Sonstige Vermögenswerte	5,37
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)	
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	-	Verkauf	USD	-	USD	–
13.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	GBP	6		-
13.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	11	Verkauf	GBP	9		-
13.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	4	Verkauf	USD	5		-
13.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	321	Verkauf	USD	391		-
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2)									-
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)									-
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 2)								USD	–

Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventarwerts
Stammaktien – 97,09 % (28. Februar 2019: 95,25 %)				
Brasilien – 5,58 % (28. Februar 2019: 2,71 %)				
	43	Cosan Ltd	592	2,21
BRL	13	IRB Brasil Resseguros S/A	317	1,19
BRL	67	MRV Engenharia e Participacoes SA	317	1,19
BRL	65	Odontoprev SA	263	0,99
			1.489	5,58
China – 26,14 % (28. Februar 2019: 27,34 %)				
	10	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.800	6,74
HKD	210	Brilliance China Automotive SK Holdings Co Ltd	223	0,84
HKD	373	CNOOC Ltd	558	2,09
HKD	1.210	Industrial & Commercial Bank of China Ltd, Class H	765	2,86
HKD	100	AIA Group Ltd	304	1,14
HKD	80	Ping An Insurance Group Co of China Ltd, Class H	914	3,43
HKD	93	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	276	1,03
HKD	28	Sunny Optical Technology GLOBALWAFERS CO LTD	396	1,49
HKD	42	Tencent Holdings Ltd	1.741	6,52
			6.977	26,14
Hongkong – 4,87 % (28. Februar 2019: 4,34 %)				
HKD	72	AIA Group Ltd	706	2,65
HKD	143	China Gas Holdings Ltd	593	2,22
			1.299	4,87
Ungarn – 2,85 % (28. Februar 2019: 2,90 %)				
HUF	19	OTP Bank Plc	762	2,85
Indien – 11,73 % (28. Februar 2019: 8,29 %)				
INR	17	Asian Paints Ltd	375	1,40
INR	16	HDFC Bank Ltd	506	1,90
INR	66	ICICI Bank Ltd	382	1,43
INR	19	Kotak Mahindra Bank Ltd	381	1,43
INR	6	Maruti Suzuki India Ltd	498	1,87
INR	44	GLOBALWAFERS CO LTD	686	2,57
INR	5	Shree Cement Ltd	301	1,13
			3.129	11,73
Indonesien – 2,99 % (28. Februar 2019: 2,42 %)				
IDR	1.857	Bank Rakyat Indonesia Persero TBK PT	559	2,09
IDR	568	Tower Bersama Infrastructure TBK PT	239	0,90
			798	2,99
Malaysia – 1,00 % (28. Februar 2019: 1,11 %)				
MYR	357	Genting Malaysia Bhd	267	1,00
Mexiko – 2,12 % (28. Februar 2019: 2,41 %)				
MXN	72	Grupo Financiero Banorte SAB De CV	378	1,42
MXN	105	Mexichem SAB de CV	187	0,70
			565	2,12
Peru – 3,70 % (28. Februar 2019: 4,23 %)				
	3	Credicorp Ltd	695	2,61
	9	Southern Copper Corp	292	1,09
			987	3,70
Philippinen – 0,81 % (28. Februar 2019: 0,89 %)				
PHP	145	Robinsons Retail Holdings Inc	217	0,81
Russland – 4,09 % (28. Februar 2019: 3,93 %)				
	8	LUKOIL PJSC ADR	676	2,53
	30	Sberbank von Russland PJSC ADR	416	1,56
			1.092	4,09
Südafrika – 3,56 % (28. Februar 2019: 4,04 %)				
ZAR	4	Naspers Ltd	949	3,56
Südkorea – 14,10 % (28. Februar 2019: 15,49 %)				
KRW	2	LG Chem Ltd	649	2,43
	KRW	LG Household & Health Care Ltd.	322	1,21
KRW	52	Samsung Electronics Co Ltd	1.910	7,16
KRW	2	Samsung Electronics Co Ltd	332	1,24
KRW	9	SK Hynix Inc	550	2,06
			3.763	14,10
Taiwan – 10,57 % (28. Februar 2019: 12,01 %)				
TWD	50	LG Electronics Inc	234	0,87
TWD	23	GLOBALWAFERS CO LTD	213	0,80
TWD	2	Largan Precision Co Ltd	249	0,93
TWD	13	St Shine Optical Co Ltd	189	0,71
TWD	234	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.937	7,26
			2.822	10,57
Türkei – 0,72 % (28. Februar 2019: 0,84 %)				
TRY	86	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	191	0,72
USA – 2,26 % (28. Februar 2019: 2,30 %)				
	3	Netscout Systems Inc	604	2,26
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 28.728)			25.911	97,09
Vorzugsaktien – 1,80 % (28. Februar 2019: 2,04 %)				
Brasilien – 1,80 % (28. Februar 2019: 2,04 %)				
BRL	59	Itau Unibanco Holding SA	480	1,80
Vorzugsaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 602)			480	1,80
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte			26.391	98,89
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			26.391	98,89
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			296	1,11
Nettovermögen insgesamt		USD	26.687	100,00

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

ABKÜRZUNGEN:

ADR	American Depositary Receipt
BRL	– Brasilianische Real
HKD	– Hongkong-Dollar
HUF	– Ungarische Forint
IDR	– Indonesische Rupiah
INR	- Indische Rupie
KRW	– Südkoreanische Won
MXN	– Mexikanische Peso
MYR	– Malaysischer Ringgit
PHP	– Philippinische Peso
TRY	- Türkische Lira
TWD	– Taiwanesische Dollar
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,57
Sonstige Vermögenswerte	1,43
Gesamtvermögen	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2017

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) EUR	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien – 94,73 % (28. Februar 2019: 97,87 %)			
Denmark – 4,51 % (28. Februar 2019: 3,84 %)			
DKK	2 Coloplast A/S	262	4,51
Frankreich – 10,10 % (28. Februar 2019: 10,69 %)			
	1 Kering SA	334	5,76
	1 L'Oreal SA	252	4,34
		586	10,10
Deutschland – 11,39 % (28. Februar 2019: 10,08 %)			
	2 Adidas AG	412	7,10
	16 Infineon Technologies AG	249	4,29
		661	11,39
Israel – 3,54 % (28. Februar 2019: 4,13 %)			
USD	2 Check Point Software Technologies Ltd	206	3,54
Italien – 11,93 % (28. Februar 2019: 10,81 %)			
	3 Ferrari NV	440	7,57
	7 Moncler Spa	253	4,36
		693	11,93
Niederlande – 5,22 % (28. Februar 2019: 4,41 %)			
	2 ASML Holding NV	303	5,22
Spanien – 3,41 % (28. Februar 2019: 3,59 %)			
	3 Amadeus IT Group SA	198	3,41
Schweden – 12,44 % (28. Februar 2019: 11,84 %)			
SEK	12 Assa Abloy ab	224	3,85
SEK	10 Atlas Copco ab	257	4,43
SEK	6 Sechskant ab	241	4,16
		722	12,44
Schweiz – 13,86 % (28. Februar 2019: 17,56 %)			
CHF	– Partners Group Holding AG	183	3,14
CHF	1 Straumann Holding AG	365	6,30
CHF	2 Temenos AG	257	4,42
		805	13,86
Großbritannien – 14,22 % (28. Februar 2019: 16,53 %)			
GBP	39 Beazley Plc	247	4,26
GBP	2 Spirax-Sarco Engineering Plc	160	2,75
	7 Unilever NV	418	7,21
		825	14,22
USA – 4,11 % (28. Februar 2019: 4,39 %)			
USD	– Mettler-Toledo International Inc	238	4,11
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten EUR 5.124)		5.499	94,73
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		5.499	94,73
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		5.499	94,73
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		306	5,27
Nettovermögen insgesamt		EUR 5.805	100,00

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

ABKÜRZUNGEN:

CHF – Schweizer Franken
DKK – Dänische Kronen
GBP – Britisches Pfund
SEK – Schwedische Kronen
USD – US-Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,27
Sonstige Vermögenswerte	5,73
Gesamtvermögen	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)			wert (in Tsd.) EUR	% des Netto-inven-tar-werts
Stammaktien – 90,39 % (28. Februar 2019: 92,15 %)				
Australien – 5,74 % (28. Februar 2019: 9,25 %)				
AUD	6.880	Spark Infrastructure Group	9.708	1,96
AUD	2.046	Transurban-Gruppe	18.736	3,78
			28.444	5,74
Brasilien – 0,92 % (28. Februar 2019: 0,00 %)				
BRL	216	Äquatorial Energia SA	4.552	0,92
Kanada – 16,69 % (28. Februar 2019: 12,45 %)				
CAD	500	Emera Inc	19.688	3,97
CAD	852	Enbridge Inc	25.933	5,24
CAD	339	Fortis Inc/Kanada	12.728	2,57
CAD	1.442	Hydro One Ltd, 144A	24.304	4,91
			82.653	16,69
China – 3,58 % (28. Februar 2019: 4,86 %)				
HKD	10.282	Beijing Capital International GLOBALWAFERS CO LTD	7.835	1,58
HKD	6.977	China Merchants Port SK Holdings Co Ltd	9.872	2,00
			17.707	3,58
Frankreich – 5,17 % (28. Februar 2019: 6,00 %)				
	54	Aeroports de Paris	8.418	1,70
	173	Vinci SA	17.211	3,47
			25.629	5,17
Italien – 4,28 % (28. Februar 2019: 4,58 %)				
	528	Spa Atlantia	11.734	2,37
	1.649	Terna Rete Elettrica Nazionale Spa	9.453	1,91
			21.187	4,28
Mexiko – 1,27 % (28. Februar 2019: 4,46 %)				
MXN	5.986	GMexico Transportes SAB De CV, 144A	6.270	1,27
Spanien – 7,03 % (28. Februar 2019: 2,07 %)				
	468	Ferrovial SA	12.130	2,45
	1.255	Red Electrica Corp SA	22.670	4,58
			34.800	7,03
Großbritannien – 15,41 % (28. Februar 2019: 16,33 %)				
GBP	1.783	National Grid Plc	16.996	3,43
GBP	962	Pennon Group PLC	8.065	1,63
GBP	881	Severn Trent Plc	20.203	4,08
GBP	756	SSE Plc	9.648	1,95
GBP	2.371	United Utilities Group Plc	21.396	4,32
			76.308	15,41
USA – 30,30 % (28. Februar 2019: 31,81 %)				
USD	116	American Electric Power Co Inc Inc	9.652	1,95
USD	247	Aqua America Inc	9.950	2,01
USD	403	Gibson Energy Inc	21.871	4,42
USD	301	Clearway Energy Inc 'C'	4.847	0,98
USD	282	Gibson Energy Inc	19.943	4,03
USD	256	FirstEnergy Corp	10.726	2,17
USD	115	NextEra Energy Partners LP	5.362	1,08
USD	55	Norfolk Southern Corp	8.690	1,75
USD	87	Unternehmen Des Öffentlichen Dienstes Gruppe Inc	4.811	0,97
USD	173	Sempra Energy	22.273	4,50
USD	132	Union Pacific Corp	19.443	3,93
USD	580	Williams Cos Inc/The	12.453	2,51
			150.021	30,30
Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten EUR 421.333)			447.571	90,39
Immobilienfonds (REIT) – 2,35 % 28. Februar 2019 4,71 %)				
USA – 2,35 % (28. Februar 2019: 3,92 %)				
USD	88	Crown Castle International Corp. KT Corp	11.655	2,35
Summe Immobilienfonds (REIT) (Anschaffungskosten EUR 8.600)			11.655	2,35
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Anlagen (Anschaffungskosten USD 429.933)			459.226	92,74
Devisenterminkontrakte – 0,20 % 28. Februar 2019 0,32 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			995	0,20
Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte			460.221	92,94
Devisenterminkontrakte – (0,13 %) (28. Februar 2019: 0,05 %)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(644)	(0,13)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten			(644)	(0,13)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			459.577	92,81
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			35.584	7,19
Gesamtnettovermögen			EUR 495.161	100,00

- Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf EUR 0 oder weniger als EUR 1.000, 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 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf EUR 30.574.000 und machten 6.18 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

AUD – Australischer Dollar
BRL – Brasilianischer Real
CAD – Kanadischer Dollar
GBP – Britisches Pfund
HKD – Hongkong-Dollar
MXN – Mexikanischer Peso
USD – US-Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermö-genswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,10
Derivate	0,20
Sonstige Vermögenswerte	7,70
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ende der Laufzeit	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.941	Verkauf	BRL	13.494	EUR (24)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	96	Verkauf	BRL	426	2
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	36	Verkauf	EUR	32	-
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	BRL	13.920	Verkauf	EUR	3.286	(227)
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	29	Verkauf	EUR	32	-
03.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	32	Verkauf	USD	34	-
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	105	Verkauf	EUR	95	1
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	-	Verkauf	EUR	-	-
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	BRL	400	Verkauf	EUR	87	1
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	28	Verkauf	EUR	31	-
04.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	4.231	Verkauf	USD	4.680	(27)
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	USD	39.205	Verkauf	EUR	35.049	592
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	5.368	Verkauf	EUR	5.826	116
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	SGD	406	Verkauf	EUR	262	4
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	SGD	2	-
12.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.495	Verkauf	USD	2.782	(32)
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	5.839	Verkauf	AUD	6.483	17
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.062	Verkauf	AUD	1.741	(4)
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	4.931	Verkauf	AUD	8.937	(16)
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	147	Verkauf	BRL	668	1
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	806	Verkauf	BRL	2.485	6
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	684	Verkauf	BRL	3.426	6
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	11.714	Verkauf	CAD	19.116	(86)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Ende der Laufzeit	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) von Kontrakten (in Tsd.)
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	BRL	92	Verkauf	CAD	30	EUR	-
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	800	Verkauf	CAD	717		-
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.520	Verkauf	CAD	3.724		(22)
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	MXN	11.697	Verkauf	CAD	771		3
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	204	Verkauf	CAD	184		-
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	19.104	Verkauf	EUR	12.939		98
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	BRL	26	Verkauf	EUR	6		-
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	MXN	3.155	Verkauf	EUR	140		2
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	16.055	Verkauf	EUR	17.728		33
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	270	Verkauf	EUR	164		1
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	MXN	16.278	Verkauf	GBP	660		5
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.408	Verkauf	GBP	776		4
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	12.885	Verkauf	GBP	7.897		56
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.343	Verkauf	GBP	2.121		(4)
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	BRL	146	Verkauf	GBP	29		-
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.677	Verkauf	MXN	40.898		9
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	361	Verkauf	MXN	7.968		1
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	1.983	Verkauf	MXN	29.666		14
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	5.074	Verkauf	USD	5.631		(40)
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	GBP	22.814	Verkauf	USD	27.963		(158)
25.09.19	BNY Mellon	Kauf	CAD	27.972	Verkauf	USD	21.020		(3)
01.10.19	BNY Mellon	Kauf	EUR	87	Verkauf	BRL	400		(1)
01.10.19	BNY Mellon	Kauf	BRL	13.410	Verkauf	EUR	2.912		23
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR 1.291)									995
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR (212))									(644)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): EUR 1.079)								EUR	351

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund**^

Vermögensaufstellung zum 31. August 2019

Anteile (in Tsd.)			wert (in Tsd.) USD	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien – 92,49 % (28. Februar 2019: 88,94 %)				
Brasilien – 12,93 % (28. Februar 2019: 9,79 %)				
BRL	20	CCR SA	78	2,85
BRL	4	Centrais Eletricas Brasileiras SA	47	1,70
BRL	3	CIA de Saneamento Basico tun Estado de Sao Paulo	31	1,13
BRL	2	CIA de Saneamento de Minas Gerais-COPASA	29	1,04
BRL	27	EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA	82	2,98
BRL	2	Äquatorial Energia SA	35	1,26
BRL	11	Neoenergia SA	54	1,97
			356	12,93
Chile – 5 % (28. Februar 2019: 3,20 %)				
CLP	153	Aguas Andinas SA	83	3,03
CLP	508	Enel Americas SA	83	3,02
			166	6,05
China – 1,42 % (28. Februar 2019: 14,37 %)				
HKD	97	Beijing Capital International GLOBALWAFERS CO LTD	81	2,95
HKD	54	Beijing Enterprises Water Group Ltd	28	1,03
HKD	128	China Everbright International Ltd	100	3,64
HKD	67	China Merchants Port Holdings Co Ltd	105	3,80
			314	11,42
Hongkong – 6,00 % (28. Februar 2019: 6,12 %)				
HKD	65	Canvest Umwelt Protection Group Co Ltd	31	1,11
HKD	33	China Gas Holdings Ltd	134	4,89
			165	6,00
Indien – 05 % (28. Februar 2019: 25,42 %)				
INR	40	Bharti Infratel Ltd	142	5,14
INR	14	Container Corp Of India Ltd	98	3,56
INR	50	Gujarat State Petronet Ltd	155	5,64
INR	18	Indraprastha Gas Ltd	85	3,10
INR	26	IRB Infrastructure Developers Ltd	28	1,01
INR	10	Mahanagar Gas Ltd	117	4,27
INR	8	Petronet LNG Ltd	31	1,13
INR	31	Power Grid Corp of India Ltd	88	3,20
			744	27,05
Indonesien – 5,12 % (28. Februar 2019: 4,80 %)				
IDR	358	Jasa Marga Tbk PT	141	5,12
Malaysia – 5,59 % (28. Februar 2019: 5,73 %)				
MYR	79	Malaysia Airports Holdings Bhd	154	5,59
Mexiko – 10,81 % (28. Februar 2019: 12,93 %)				
MXN	28	Cemex SAB de CV	26	0,95
MXN	38	GMexico Transportes SAB de CV, 144A	44	1,59
MXN	3	Grupo Aeroportuario del Cemex SAB de CV	32	1,18
MXN	3	Grupo Aeroportuario del Cemex SAB de CV	51	1,87
MXN	21	Infrastrukturtura Energetica Nova Cemex SAB de CV	88	3,19
MXN	89	Cemex SAB de CV	56	2,03
			297	10,81
Philippinen – 6,01 % (28. Februar 2019: 5,40 %)				
PHP	37	Internationales Containerterminal Services Inc	95	3,44
PHP	744	Metro Pacific Investments Corp	70	2,57
			165	6,01
Thailand – 1,51 % (28. Februar 2019: 1,18 %)				
THB	4	Electricity Generating PCL ∞	42	1,51
COM-Lagerbestand gesamt (Kosten USD 2.718)			2.544	92,49
Vorzugsaktien – 2,02 % (28. Februar 2019: 3,27 %)				
Brasilien – 2,02 % (28. Februar 2019: 3,27 %)				
BRL	8	Cia Energetica de Sao Paulo, Class B	56	2,02
Vorzugsaktien insgesamt (Anschaffungskosten USD 47)			56	2,02
Immobilieninvestmentgesellschaft – 3,29 % (28. Februar 2019: 2,79 %)				
Mexiko – 3,29 % (28. Februar 2019: 2,79 %)				
MXN	88	CFE Capital S de RL de CV	90	3,29
Summe Immobilienfonds (REIT) (Anschaffungskosten USD 84)			90	3,29
Summe Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 3.096)			2.690	97,80
Gesamtanlagevermögen zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte			2.690	97,80
Devisenterminkontrakte – (1,23 %) 28. Februar 2019 0,00 %)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(34)	(1,23)
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten			(34)	(1,23)
Summe erfolgswirksam zum Fair Value bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			2.656	96,57
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			95	3,43
Nettovermögen insgesamt		USD	2.751	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf USD 0, weniger als USD 1.000, 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 2019 beliefen sich diese Wertpapiere auf USD 44.000 und machten 1,59 % des Nettovermögens aus.

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

ABKÜRZUNGEN:

BRL – Brasilianische Real
CLP – Chilenischer Peso
HKD – Hongkong-Dollar
IDR – Indonesische Rupiah
INR – Indische Rupie
MXN – Mexikanische Peso
MYR – Malaysischer Ringgit
PHP – Philippinische Peso
THB – Thailändische Baht

Analyse des Gesamtvermögens	% des Insgesamt Vermögenswerte
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,25
Sonstige Vermögenswerte	5,75
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Ablaufdatum	Gegenpartei	Währung Kaufen (Tsd.)			Währung Verkaufen (Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abwertung) Währung von Verträgen (Tsd.)	
12.09.19	BNY Mellon	Buy	EUR	1.497	Verkauf	USD	1.625	USD	(34)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.) USD 6)									–
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD –)									(34)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2019 (in Tsd.): USD 6)								USD	(34)

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

Bilanz

(in Tsd.)	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	
	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Anmerkung 7)	USD 196	USD 422	USD 12.838	USD 72.048	EUR 1.559	EUR 743	USD 345	USD 198
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	3.457	1.074	39.969	12.111	2.081	1.742	18	40
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	205.853	178.304	1.464.956	1.012.867	121.014	112.987	20.461	22.623
Verpfändete Anlagen	–	–	1.094	–	–	–	–	–
Optionen	118	21	2.416	580	13	–	–	–
Swapkontrakte	1.123	860	9.370	5.986	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	2.778	2.293	11	36	4	1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	493	440	6.032	3.224	254	45	1	10
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	7.460	15.965	44.433	97.130	–	–	325	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	2.134	342	2.056	1.960	–	–	41	180
Zinsforderungen	1.073	977	6.810	6.118	603	882	262	314
Dividendenforderungen	37	26	11	26	27	36	1	–
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**221.944**	**198.431**	**1.592.763**	**1.214.343**	**125.562**	**116.471**	**21.458**	**23.366**
LAUFENDE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung (Barmittel) (Erläuterung 7)	417	3	2.465	59	53	71	42	43
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	460	772	2.874	625	71	58	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	26.959	42.086	197.420	234.906	–	1.033	114	30
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	132	33	921	266	274	44	–	–
Swapkontrakte	3.587	361	24.960	3.358	110	82	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	9	–	6.187	1.304	192	28	18	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	37	300	5.713	5.196	803	578	1	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	109	74	40	28	–	–	16	13
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	154	108	695	389	3	3	24	15
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	13	10	74	46	8	7	5	4
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	22	16	45	22	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	153	109	1.523	40.615	–	–	–	27
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende – zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	56	73	216	219	51	69	52	74
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**32.108**	**43.945**	**243.133**	**287.033**	**1.565**	**1.973**	**272**	**206**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**USD 189.836**	**USD 154.486**	**USD 1.349.630**	**USD 927.310**	**EUR 123.997**	**EUR 114.498**	**USD 21.186**	**USD 23.160**

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Global Inflations Management Fund		Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund		Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Anmerkung 7)	USD 1.961	USD 747	USD 115	USD 130	USD 2.334	USD 1.970	USD 111	USD 288
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	182	138	983	888	1.853	3.637	3.471	1.374
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	99.146	118.595	35.235	37.252	500.704	491.992	201.182	100.306
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	5	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	117	77	189	104	658	346	1.277	2.256
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	250	27	108	166	2.182	73	1	22
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	5.286	1.066	–	–	–	244	–	130
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	24	14	–	–	1.105	362	369	100
Zinsforderungen	1.166	1.336	108	99	6.725	6.189	1.340	759
Dividendenforderungen	24	19	1	1	10	17	32	9
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**108.156**	**122.019**	**36.744**	**38.640**	**515.571**	**504.830**	**207.783**	**105.244**
LAUFENDE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung (Barmittel) (Erläuterung 7)	–	70	260	32	–	825	778	44
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	250	31	6	57	32	–	20	2
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	752	613	–	–	–	244	–	3.956
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	44	28	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	400	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	328	122	67	34	1.281	625	230	166
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	413	324	–	22	1.280	504
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	45	31	–	–	15	11	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	120	106	9	7	329	277	44	12
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	9	8	5	5	31	26	14	7
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	12	11	1	–	28	23	1	1
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	5.256	86	–	88	1.683	902	237	95
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende – zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	95	131	36	55	605	235	58	76
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**6.867**	**1.209**	**841**	**630**	**4.004**	**3.190**	**3.062**	**4.863**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**USD 101.289**	**USD 120.810**	**USD 35.903**	**USD 38.010**	**USD 511.567**	**USD 501.640**	**USD 204.721**	**USD 100.381**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		Legg Mason Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	
Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
USD 15.562	USD 19.986	USD 878	USD 5	USD 1.039	USD 617	USD 467	USD 1.201
6.121	5.200	65	102	74	148	74	67
630.100	690.193	159.876	149.537	20.027	23.742	36.192	35.764
–	531	–	–	–	–	–	–
–	84	–	–	26	18	34	14
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
2.086	11.426	–	11	87	11	73	4
164	69	5	19	–	6	–	6
–	–	–	–	–	–	–	–
2.367	2.165	972	547	–	369	633	–
16	1.061	180	40	–	26	–	–
6.886	7.844	2.126	2.243	292	331	518	520
3	3	16	6	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	1	–	–	–	–	–
663.305	**738.562**	**164.119**	**152.510**	**21.545**	**25.268**	**37.991**	**37.576**
540	2.816	–	276	–	–	–	11
57	134	–	20	2	6	–	–
134	31	3.390	627	–	138	–	–
–	–	–	–	35	14	–	4
624	972	–	–	–	11	–	9
–	–	–	–	–	–	–	–
3.358	1.236	43	–	97	2	49	–
1.762	1.532	12	1	9	–	10	–
–	–	–	–	–	–	–	–
90	95	65	47	12	10	–	–
226	201	102	78	30	28	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
38	35	12	10	4	4	6	5
17	14	11	9	–	2	–	–
1.770	8	5.711	60	51	771	1.500	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
194	229	92	126	62	89	31	45
8.810	**7.303**	**9.438**	**1.254**	**302**	**1.075**	**1.596**	**74**
USD 654.495	**USD 731.259**	**USD 154.681**	**USD 151.256**	**USD 21.243**	**USD 24.193**	**USD 36.395**	**USD 37.502**

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	
Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
USD 8.106	USD 5.836	USD 172	USD 278
6.153	4.215	1.146	1.027
272.268	252.001	76.471	69.223
–	28	49	27
28	–	–	–
–	–	–	–
–	–	–	–
1.565	1.594	495	104
1.142	483	43	38
–	–	–	–
7.364	1.439	–	204
78	213	–	–
1.766	1.849	684	730
89	73	12	11
–	–	–	–
–	–	–	–
298.559	**267.731**	**79.072**	**71.642**
1.896	116	4	38
144	75	26	28
24.827	14.961	1.174	1.718
611	178	–	–
–	–	646	301
–	–	–	–
1.763	434	52	125
2.077	1.904	106	233
–	–	–	–
1	1	–	2
60	48	4	1
–	–	–	–
17	14	8	6
–	–	1	–
6.229	–	–	213
–	–	–	–
–	–	–	–
–	–	–	–
72	107	43	61
37.697	**17.838**	**2.064**	**2.726**
USD 260.862	**USD 249.893**	**USD 77.008**	**USD 68.916**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^		Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	
	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Anmerkung 7)	EUR 5.860	EUR 5.714	USD 115.451	USD 129.304	USD 3.388	USD 3.006	USD 5.431	USD 14.228
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	–	–	1.680.288	441.950	95	66	14.188	6.362
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	63.048	69.661	6.029.323	6.315.618	31.013	31.868	727.195	690.279
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	8.244	19.088	164	140	1.751	172
Swapkontrakte	259	227	199.896	227.843	119	68	1.373	756
Swaptions	–	–	110	431	–	–	39	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	88.363	78.254	415	99	2.658	17.918
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	106.607	134.631	4	–	1.661	397
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	–	6.607	67	–	359	971
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	18.634	6.675	–	–	436	–
Zinsforderungen	809	1.009	74.292	77.462	523	647	7.338	7.221
Dividendenforderungen	–	–	336	725	90	98	31	6
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	6	7	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**69.982**	**76.618**	**8.321.544**	**7.438.588**	**35.878**	**35.992**	**762.460**	**738.310**
LAUFENDE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung (Barmittel) (Erläuterung 7)	–	–	31.995	105.305	–	3	501	–
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	62	31	62.645	55.896	24	–	2.226	121
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	–	249.481	7.155	139	178	6.323	4.290
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	77.844	11.265	152	125	656	1
Swapkontrakte	–	–	692.412	95.322	–	54	10.764	1.972
Swaptions	–	–	–	175	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	399	383	160.631	31.992	362	48	2.408	605
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	392.074	111.918	–	–	991	1.614
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	7.396	6.495	11	4	4	3
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	6	6	380	331	5	4	44	35
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	505	447	–	–	1	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	49.013	29.140	–	–	–	8
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende – zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	45	59	5.454	1.278	103	93	145	145
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**512**	**479**	**1.729.830**	**456.719**	**796**	**509**	**24.063**	**8.794**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**EUR 69.470**	**EUR 76.139**	**USD 6.591.714**	**USD 6.981.869**	**USD 35.082**	**USD 35.483**	**USD 738.397**	**USD 729.516**

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^		Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Anmerkung 7)	USD 23.084	USD 2.387	USD 9	USD 30.340	USD 304	USD –	USD 13.139	USD 1.876
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	5.731	1	20.672	22.488	11	–	2.471	1
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	921.916	1.049.601	1.005.328	1.178.704	16.293	96.533	573.293	643.671
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	420	1.118	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	4.620	10.266	2.178	10.319	324	270	813	5.081
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	6.404	2.701	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	1.311	–	–	1.198	–	–	7.076
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	2.999	1.738	61	88	4	5	551	187
Zinsforderungen	8.764	10.767	8.412	11.581	295	1.337	5.486	6.353
Dividendenforderungen	896	701	633	583	3	3	449	297
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**968.010**	**1.076.772**	**1.043.697**	**1.256.804**	**18.852**	**99.266**	**596.202**	**664.542**
LAUFENDE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung (Barmittel) (Erläuterung 7)	–	27	11.868	27	–	10	–	16
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	–	1.760	469	7.671	239	262	–	950
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	1.311	–	–	1.213	981	–	13
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	18	29	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	22.741	7.041	23.080	7.763	492	332	14.646	3.993
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	2.195	4.357	4	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	2	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	550	541	507	512	8	7	237	241
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	54	52	55	60	6	7	35	33
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	61	70	5	5	–	–	6	7
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	6.405	3.792	–	27.717	–	7	46	7.285
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende – zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	1.945	1.575	1.208	261	47	67	713	174
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**31.756**	**16.169**	**39.387**	**48.373**	**2.029**	**1.702**	**15.683**	**12.712**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**USD 936.254**	**USD 1.060.603**	**USD 1.004.310**	**USD 1.208.431**	**USD 16.823**	**USD 97.564**	**USD 580.519**	**USD 651.830**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^		Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	
Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
USD 634	USD 202	USD 9.978	USD 510	USD –	USD –	USD 127	USD 48
1.503	1.102	6.179	5.329	1.120	343	94	173
51.290	48.144	1.552.386	1.177.981	1.005.365	937.626	110.719	113.031
–	–	–	–	–	–	–	–
12	3	–	–	–	–	–	–
–	–	1.433	–	–	–	–	–
–	–	9	–	–	–	–	–
330	204	59	1.706	–	–	6	2.754
235	458	3.712	244	258	100	31	49
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	14.269	30.257	–	416
–	–	3.731	3.688	–	–	–	–
417	453	5.143	3.839	3.449	2.974	1.128	1.244
28	13	180	118	103	46	4	5
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
54.449	**50.579**	**1.582.810**	**1.193.415**	**1.024.564**	**971.346**	**112.109**	**117.720**
–	–	–	2	9.081	2.265	–	–
12	13	–	–	91	71	31	49
397	–	18.396	–	74.035	74.678	120	917
218	55	–	–	–	–	–	–
–	–	2.626	1.781	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
141	859	8.571	131	22	–	69	–
493	100	2.921	437	479	207	2	5
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
27	12	525	357	–	–	8	2
–	–	–	–	–	–	–	–
6	5	82	58	54	44	9	8
–	–	5	5	–	–	1	–
–	–	2.667	13.513	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
67	61	238	252	138	143	44	57
1.361	**1.105**	**36.031**	**16.536**	**83.900**	**77.408**	**284**	**1.038**
USD 53.088	**USD 49.474**	**USD 1.546.779**	**USD 1.176.879**	**USD 940.664**	**USD 893.938**	**USD 111.825**	**USD 116.682**

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 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
USD 33.355	USD 13.552	USD –	USD 53	USD 437	USD 22	USD 6	USD –
14.961	776	–	–	797	–	20	–
1.642.381	1.998.257	103.063	111.573	40.795	42.168	10.235	10.855
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	1.611	204	225	79	237	127
–	–	–	–	–	–	–	–
7.394	30.178	1.221	981	357	220	35	36
–	219	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	34.384	–	18.384	1.002	1.493	195	–
–	–	297	29	–	–	–	–
15.997	21.178	984	856	243	218	194	151
1.487	2.241	17	14	3	3	1	–
–	–	–	–	–	–	4	11
2	–	–	–	–	–	–	–
1.715.577	**2.100.785**	**107.193**	**132.094**	**43.859**	**44.203**	**10.927**	**11.180**
362	135.917	1.219	1	–	32	–	1
–	3.006	1.208	260	240	–	75	13
–	–	–	26.573	–	–	133	112
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	6	68	563	29	–	7
–	–	–	–	–	–	–	–
32.855	13.725	2.607	472	532	221	255	44
–	–	–	–	–	–	3	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
223	217	74	62	22	16	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
94	99	9	8	6	5	4	3
–	–	9	7	–	–	–	–
–	–	5.115	1.924	101	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
3.249	1.411	80	103	62	76	39	75
36.783	**154.375**	**10.327**	**29.478**	**1.526**	**379**	**509**	**255**
USD 1.678.794	**USD 1.946.410**	**USD 96.866**	**USD 102.616**	**USD 42.333**	**USD 43.824**	**USD 10.418**	**USD 10.925**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ Zum 31. August 2019	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ Zum 28. Februar 2019	Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ Zum 31. August 2019	Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ Zum 28. Februar 2019	Legg Mason ClearBridge Value Fund Zum 31. August 2019	Legg Mason ClearBridge Value Fund Zum 28. Februar 2019	Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^ Zum 31. August 2019	Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^ Zum 28. Februar 2019
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Anmerkung 7)	USD 2.229	USD 5.063	USD 2	USD –	USD 22.944	USD 5.561	USD 770	USD 1.026
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	23.135	9.292	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	363.395	339.049	3.343	4.729	320.726	338.294	14.790	31.043
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	3.313	3.555	–	6	–	2	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	6.925	924	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	1	39	–	–
Zinsforderungen	4.235	4.334	–	–	14	5	1	2
Dividendenforderungen	14	20	7	11	299	381	56	94
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	1	24	27	–	–	13	6
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**403.246**	**362.238**	**3.376**	**4.773**	**343.984**	**344.282**	**15.630**	**32.171**
LAUFENDE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung (Barmittel) (Erläuterung 7)	7.741	–	–	–	–	969	–	–
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	1.445	2.526	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	14.536	2.766	20	–	3	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	8.095	3.582	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	2	–	–	–	243	207	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	21	17	4	3	25	18	5	4
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	16	15	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	180	454	–	49
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende – zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	1.625	464	22	39	101	119	43	59
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**33.465**	**9.355**	**46**	**42**	**568**	**1.782**	**48**	**112**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**USD 369.781**	**USD 352.883**	**USD 3.330**	**USD 4.731**	**USD 343.416**	**USD 342.500**	**USD 15.582**	**USD 32.059**

(in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund Zum 31. August 2019	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund Zum 28. Februar 2019	Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ Zum 31. August 2019	Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ Zum 28. Februar 2019	Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund Zum 31. August 2019	Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund Zum 28. Februar 2019	Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund Zum 31. August 2019	Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund Zum 28. Februar 2019
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Anmerkung 7)	USD 1.919	USD 1.152	USD 278	USD 132	USD –	USD 21	USD –	USD 523
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	42.698	50.442	12.713	8.869	513.753	891.502	74.320	93.688
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	1	6	–	2	74	241	1	2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	–	–	592	1.580	41	145
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	98	1	–	286	1.071	88	6
Zinsforderungen	1	1	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	76	138	14	11	184	322	14	80
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	17	19	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**44.695**	**51.837**	**13.023**	**9.033**	**514.889**	**894.737**	**74.464**	**94.444**
LAUFENDE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung (Barmittel) (Erläuterung 7)	–	–	–	–	520	506	200	–
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	519	–	–	972	810	130	274
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	28	3	12	1	667	80	2	2
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	46	37	–	–	538	731	92	96
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	6	5	4	3	36	44	8	7
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	7	6	1	–	94	116	18	18
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	211	150	–	–	738	9.134	273	485
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende – zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	45	70	26	36	251	296	66	94
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**343**	**790**	**43**	**40**	**3.816**	**11.717**	**789**	**976**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**USD 44.352**	**USD 51.047**	**USD 12.980**	**USD 8.993**	**USD 511.073**	**USD 883.020**	**USD 73.675**	**USD 93.468**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund		Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
USD 2.719	USD 567	USD 20.149	USD 17.321	USD 9.936	USD 16.765
–	–	300	–	–	–
198.803	199.056	1.312.935	1.440.452	1.110.314	1.510.484
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	65	260	6	523
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
265	1.212	–	276	13	6.244
7.718	80	5.706	3.417	101	1.946
1	1	10	13	5	2
251	297	1.068	1.206	490	712
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	1	–
209.757	**201.213**	**1.340.233**	**1.462.945**	**1.120.866**	**1.536.676**
–	–	–	4.401	–	3
–	–	–	–	–	–
321	11	–	276	260	1.224
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	1.651	157	882	44
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
218	188	1.017	919	893	993
–	–	–	–	–	–
16	12	87	69	74	72
38	33	163	147	119	128
277	421	4.845	4.041	3.994	3.095
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
74	97	282	300	392	433
944	**762**	**8.045**	**10.310**	**6.614**	**5.992**
USD 208.813	**USD 200.451**	**USD 1.332.188**	**USD 1.452.635**	**USD 1.114.252**	**USD 1.530.684**

Legg Mason PCM US Equity Fund^		Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund		Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
USD 23	USD 23	EUR 247	EUR 473	USD 275	USD 1.973
–	–	–	–	–	–
–	–	44.872	52.505	75.462	84.678
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	220	5	4	99
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	1	82	1
–	–	17	3	2	280
–	–	–	–	–	1
–	–	642	512	299	198
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
23	**23**	**45.998**	**53.499**	**76.124**	**87.230**
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	1	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	3	58	229	8
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	44	48	58	56
–	–	–	–	–	–
–	–	6	5	8	6
–	–	4	4	14	12
–	–	1.931	51	370	361
23	23	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	102	135	159	321
23	**23**	**2.090**	**302**	**838**	**764**
USD –	**USD –**	**EUR 43.908**	**EUR 53.197**	**USD 75.286**	**USD 86.466**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fonds		Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Congruix Japan Equity Fund^		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	
	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Anmerkung 7)	USD 169	USD 67	USD 150	USD 45	JPY 90.436	JPY 94.724	USD 15.050	USD 4.660
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	50	24	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	12.526	13.284	12.842	13.376	–	–	228.090	253.479
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	26	11	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	7	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	1	–	–	–	211	4.312
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsforderungen	–	1	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	24	23	54	48	–	–	776	579
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	5	10	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**12.774**	**13.416**	**13.073**	**13.480**	**90.436**	**94.724**	**244.127**	**263.030**
LAUFENDE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung (Barmittel) (Erläuterung 7)	–	–	–	1	–	–	1	–
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	26
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	7	23	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	13	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	2.833
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	16	14	–	–	202	182
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	4	4	4	3	–	–	19	15
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	1	–	–	–	16	13
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	1	–	–	–	4.530
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	–	–	–	–	90.436	94.724	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende – zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	94	106	47	67	–	–	72	793
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**111**	**110**	**75**	**109**	**90.436**	**94.724**	**310**	**8.392**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**USD 12.663**	**USD 13.306**	**USD 12.998**	**USD 13.371**	**JPY –**	**JPY –**	**USD 243.817**	**USD 254.638**

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^		Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	
	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Anmerkung 7)	USD 623	USD 241	USD 1.382	USD 431	USD 362	USD 628	EUR 306	EUR 62
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	15.475	15.676	24.826	22.811	26.391	25.483	5.499	2.741
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	2	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	6	1	–	100	–	–
Zinsforderungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	18	–	21	18	20	55	4	3
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	13	–	–	24	16
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**16.116**	**15.917**	**26.235**	**23.276**	**26.773**	**26.266**	**5.833**	**2.822**
LAUFENDE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung (Barmittel) (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	18	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	19	9	9	–	3	7	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	5	3	5	4	5	4	2	1
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	2	–	1	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	6	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende – zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	29	48	30	42	78	62	26	21
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**55**	**78**	**51**	**46**	**86**	**73**	**28**	**22**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**USD 16.061**	**USD 15.839**	**USD 26.184**	**USD 23.230**	**USD 26.687**	**USD 26.193**	**EUR 5.805**	**EUR 2.800**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

	Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	
	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
	EUR 42.835	EUR 36.949
	24.746	39.155
	160.743	209.187
	–	–
	–	–
	–	–
	–	–
	1.630	313
	–	–
	5.185	4.251
	–	1.961
	2	528
	1	–
	256	270
	–	–
	–	–
	235.398	**292.614**
	284	2.272
	–	203
	–	1.199
	–	–
	–	–
	–	–
	672	1.825
	–	–
	3.628	9.669
	–	–
	293	318
	22	106
	16	15
	33	38
	482	1.618
	–	–
	66	101
	27	168
	82	106
	5.605	**17.638**
	EUR 229.793	**EUR 274.976**

	Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^	
	Zum 31. August 2019	Zum 28. Februar 2019
	EUR 31.650	EUR 24.693
	–	–
	459.226	386.228
	–	–
	–	–
	–	–
	–	–
	995	1.291
	–	–
	–	–
	88	8.621
	5.331	227
	–	–
	1.334	939
	–	–
	–	–
	498.624	**421.999**
	2	3
	–	430
	522	18.724
	–	–
	–	–
	–	–
	644	212
	–	–
	–	–
	1.436	3.327
	378	271
	–	–
	32	20
	30	22
	338	137
	–	–
	–	–
	–	–
	81	89
	3.463	**23.235**
	EUR 495.161	**EUR 398.764**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^ Zum 31. August 2019	Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^ Zum 28. Februar 2019	Legg Mason Global Funds Plc Zum 31. August 2019	Legg Mason Global Funds Plc Zum 28. Februar 2019
UMLAUFVERMÖGEN:				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Anmerkung 7)	USD 141	USD 181	USD 426.614	USD 442.178
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	–	–	1.865.313	570.439
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:				
Anlagen	2.690	2.664	23.886.621	25.050.494
Verpfändete Anlagen	–	–	1.143	586
Optionen	–	–	12.812	20.249
Swapkontrakte	–	–	216.464	237.625
Swaptions	–	–	158	431
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	6	124.822	184.133
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	136.548	144.400
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	5.699	5.417
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	88.488	246.158
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	52.505	24.729
Zinsforderungen	–	–	171.892	184.378
Dividendenforderungen	7	1	10.732	11.417
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	16	20	208	204
Sonstige Vermögenswerte	–	–	4	–
Gesamtumlaufvermögen	**2.854**	**2.872**	**27.000.023**	**27.122.838**
LAUFENDE VERBINDLICHKEITEN:				
Überziehung (Barmittel) (Erläuterung 7)	2	–	70.362	256.495
Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel (Erläuterung 7)	–	–	72.876	75.225
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	–	609.335	492.567
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:	–	–	80.914	12.063
Optionen	–	–	736.755	104.380
Swapkontrakte	–	–	–	175
Swaptions	34	–	303.654	77.254
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	419.694	133.033
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	3.988	11.735
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	3.063	8.055
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	16.042	14.417
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	24	121
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	4	2	1.555	1.346
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	1.296	1.205
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	102.742	151.413
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1.507	1.608
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	–	–	73	123
Zinsverbindlichkeiten	–	–	30	230
Dividende – zahlbar				
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	60	65	19.798	12.257
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**103**	**67**	**2.443.708**	**1.353.702**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**USD 2.751**	**USD 2.805**	**USD 24.556.315**	**USD 25.769.136**

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

Die Euro-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 RARE Infrastructure Value Fund^ wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc zum 31. August 2019 zum USD/EUR-Wechselkurs am Ende des Zeitraums von 0,9099 umgerechnet (28. Februar 2019: 0,8792).

Die Yen-Beträge für den Legg Mason Congruix Japan Equity Fund^ und den wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc zum 31. August 2019 zum USD/JPY-Wechselkurs am Ende des Zeitraums von 106,2350 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2019: 111,4650).

Die britischen Pfund-Beträge für den wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für die Legg Mason Global Funds Plc zum 31. August 2019 zum USD/GBP-Wechselkurs am Ende des Zeitraums von 0,8218 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2019: 0,7539).

µ *Zum 2. August 2019 hat den Handel eingestellt.*

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Im Namen des Verwaltungsrats

Verwaltungsratsmitglied
11. Oktober 2019

Verwaltungsratsmitglied

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2019			28. Februar 2019			28. Februar 2018		
	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 Core Bond Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 15.241	106	144,10	USD 11.129	83	133,30	USD 16.807	129	129,87
Klasse A USD ausschüttend (D)	135.919	1.260	107,89	120.608	1.193	101,07	56.470	561	100,57
Klasse B USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	242	2	125,75
Klasse B USD ausschüttend (D)	2	–	107,98	67	1	101,04	66	1	100,55
Klasse C USD thesaurierend	6.700	50	135,27	4.668	37	125,45	4.498	37	122,83
Klasse C USD ausschüttend (D)	3.691	34	107,91	2.819	28	101,09	2.902	29	100,60
Klasse E USD thesaurierend	511	5	100,51	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD thesaurierend	16.193	125	129,15	7.668	64	119,13	11.340	98	115,44
Klasse F USD ausschüttend (D)	6.049	57	106,07	3.169	32	99,37	2.853	29	98,87
Klasse X USD thesaurierend	2.772	25	113,08	2.044	20	104,35	110	1	101,18
Klasse X USD ausschüttend (D)	582	6	104,98	525	5	98,34	1	–	97,86
Klasse Premier USD thesaurierend	182	2	112,32	196	2	103,48	189	2	100,02
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	426	4	107,14	–	–	–	–	–	–
Klasse GA USD thesaurierend	1.487	11	141,32	1.518	12	130,54	1.635	13	126,84
Klasse GE USD thesaurierend	81	1	133,87	75	1	124,04	74	1	121,24
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 235.582	1.451	162,38	USD 134.687	899	149,79	USD 170.007	1.157	146,96
Klasse A USD ausschüttend (D)	43.009	363	118,62	33.130	299	110,86	32.331	290	111,43
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	975	9	103,84	1.872	19	97,71	1.717	17	99,36
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	5.527	80	103,15	3.039	44	97,55	2.345	30	99,54
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	2.368	20	107,85	703	6	101,06	–	–	–
Klasse B USD thesaurierend	–	–	–	24	–	142,17	35	–	139,78
Klasse B USD ausschüttend (D)	152	1	118,45	141	1	110,70	373	3	111,25
Klasse C USD thesaurierend	11.765	79	149,32	8.384	61	138,09	10.683	78	136,16
Klasse C USD ausschüttend (D)	6.295	53	119,45	4.904	44	111,64	6.081	54	112,21
Klasse E USD thesaurierend	13.207	108	122,60	8.192	72	113,44	11.528	103	111,97
Klasse F USD thesaurierend	354.042	2.815	125,77	191.012	1.653	115,58	174.486	1.550	112,55
Klasse F USD ausschüttend (D)	2.471	22	111,22	51	–	103,89	–	–	–
Klasse X USD thesaurierend	25.344	216	117,45	4.863	45	108,03	7.166	68	105,37
Klasse X USD ausschüttend (D)	1.373	13	103,45	967	10	96,67	972	10	97,17
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	39	–	101,99	–	–	–
Klasse Premier USD thesaurierend	569.412	3.799	149,87	440.775	3.204	137,55	320.833	2.401	133,61
Klasse Premier USD ausschüttend (M)	1.217	11	112,45	1.060	10	105,06	1.065	10	105,58
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	70.773	579	111,19	87.784	744	103,72	4.117	33	103,77
Klasse LM USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	623	6	106,08
Klasse LM Euro thesaurierend	2.181	16	123,54	1.945	16	109,40	2.342	19	98,79
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	32	–	147,91	35	–	136,94	220	1	135,15
Klasse A (G) USD thesaurierend	893	5	164,30	824	5	151,45	864	6	148,36
Klasse A (G) USD ausschüttend (D)	1.581	13	119,55	1.554	14	111,73	1.603	14	112,30
Klasse B (G) USD ausschüttend (D)	4	–	119,56	4	–	111,73	3	–	112,31
Klasse L (G) USD thesaurierend	240	2	154,44	222	2	142,72	219	2	140,51
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	1.187	10	119,56	1.099	10	111,74	1.251	11	112,31
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund									
Klasse A USD ausschüttend (D)	EUR 237	2	120,23	EUR 220	2	115,33	EUR 387	4	123,80
Klasse A Euro ausschüttend (D)	1.516	13	113,45	1.591	15	105,14	1.581	15	105,18
Klasse C USD ausschüttend (D)	190	2	120,72	215	2	115,94	307	3	124,93
Klasse F EUR ausschüttend (Q)	1	–	129,75	1	–	120,12	1	–	120,06
Klasse X EUR ausschüttend (D)	–	–	–	1	–	100,02	1	–	100,01
Klasse Premier Euro thesaurierend	324	3	108,49	–	–	–	–	–	–
Klasse LM Euro thesaurierend	120.160	1.079	111,35	110.763	1.080	102,52	109.818	1.083	101,38
Klasse GA Euro thesaurierend	1.001	7	137,00	1.057	8	126,66	1.191	9	126,29
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	450	4	125,38	449	4	116,25	480	4	116,03
Klasse GE Euro thesaurierend	118	1	129,79	201	2	120,35	203	2	120,73
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 3.204	22	148,44	USD 3.067	21	145,70	USD 6.591	47	141,60
Klasse A USD ausschüttend (D)	3.677	42	87,53	4.463	51	87,89	4.606	52	89,29
Klasse A USD ausschüttend (M)	230	2	92,51	89	1	92,84	46	–	94,29
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1.111	12	95,81	1.643	17	96,75	1.885	19	99,43
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	70	1	94,95	75	1	96,34	2.573	33	99,45
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	851	6	134,74	82	1	134,21	180	1	134,39
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	652	53	96,49	1.295	104	97,59	2.927	229	100,01
Klasse B USD thesaurierend	110	1	143,15	132	1	140,73	104	1	137,12
Klasse B USD ausschüttend (D)	99	1	87,51	145	2	87,88	102	1	89,27
Klasse C USD thesaurierend	1.356	10	139,43	1.947	14	137,21	926	7	134,02
Klasse C USD ausschüttend (D)	2.780	32	87,51	2.669	30	87,87	3.841	43	89,27
Klasse A (G) USD thesaurierend	984	7	147,07	990	7	144,47	1.208	9	140,61
Klasse A (G) USD ausschüttend (D)	4.954	56	89,10	5.442	61	89,47	5.831	64	90,89
Klasse B (G) USD ausschüttend (D)	5	–	89,20	5	–	89,57	4	–	91,01
Klasse L (G) USD thesaurierend	885	6	138,34	874	6	136,24	917	7	133,27
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	218	2	89,11	242	3	89,48	256	3	90,90
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 24.326	152	160,38	USD 23.839	155	153,85	USD 45.804	296	154,58
Klasse A USD ausschüttend (D)	40.709	355	114,74	40.316	359	112,44	43.990	373	118,04
Klasse A USD ausschüttend (M)	3.563	37	97,30	3.780	40	95,34	10.294	103	100,03
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1.276	13	95,25	1.001	11	94,13	8	–	99,84
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	192	3	94,62	74	1	93,95	42	1	100,09
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	7.891	50	143,15	7.689	48	139,53	15.325	87	144,51
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	5.957	63	85,58	6.317	65	85,22	8.863	79	92,17
Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	474	6	75,80	491	6	75,98	730	7	83,31
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	811	7	97,69	943	7	96,69	2.120	15	103,34
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	108	9	92,81	115	10	91,82	8	1	97,11
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	978	1.366	0,99	1.177	1.614	0,99	1.469	1.843	1,06
Klasse B USD thesaurierend	32	–	150,95	31	–	144,99	101	1	146,07
Klasse B USD ausschüttend (D)	684	6	114,76	375	3	112,44	1.157	10	118,05
Klasse C USD thesaurierend	10.974	75	146,88	10.996	78	141,27	12.775	90	142,65
Klasse C USD ausschüttend (D)	17.036	148	114,72	17.968	160	112,42	25.102	213	118,03
Klasse A ZAR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.886	31	936,35	243	4	938,40	–	–	–
Klasse E USD thesaurierend	1.803	14	129,39	1.887	15	124,50	2.003	16	125,85
Klasse E USD ausschüttend (D)	910	10	95,55	1.078	12	93,63	1.609	16	98,31
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	665	6	108,37	534	4	105,96	1.534	11	110,41
Klasse E EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	49	1	87,30	40	–	86,92	34	–	93,99
Klasse F USD thesaurierend	3.503	24	146,36	5.818	42	139,98	7.264	52	139,79
Klasse F USD ausschüttend (D)	9.950	104	95,57	9.695	104	93,66	6.413	65	98,32
Klasse X USD ausschüttend (D)	87	1	95,67	64	1	93,80	74	1	98,47
Klasse X GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	118	1	93,38	109	1	92,41	151	1	102,35
Klasse Premier USD thesaurierend	42.737	243	175,90	45.900	273	168,02	50.052	299	167,39
Klasse Premier USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	182	2	99,26
Klasse Premier USD ausschüttend (M)	13.938	117	118,90	33.682	289	116,50	43.859	359	122,23
Klasse Premier CHF thesaurierend (Abgesichert)	1.762	16	110,11	30.024	280	107,12	49.190	421	110,41
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	4.603	30	139,08	4.185	27	134,97	6.320	37	138,57
Klasse Premier Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	92	1	82,69	95	1	82,32	1.245	11	89,04
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	100.478	613	134,62	105.616	613	129,83	251.951	1.389	131,74
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	47.129	411	94,24	52.466	424	93,26	28.278	206	99,72
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	1.224	12	83,77	1.856	17	83,11	69.566	566	89,28
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	1.224	12	83,77	1.856	17	83,11	69.566	566	89,28
Klasse Premier GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)	91	1	90,55	293	2	89,72	14.593	111	95,86

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2019			28. Februar 2019			28. Februar 2018		
	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 Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	USD 5.792	189	121,99	USD 4.445	143	117,23	USD 8.856	257	117,98
Klasse LM AUD ausschüttend (M) (abgesichert)	72.512	986	109,24	76.692	1.005	107,57	83.608	950	113,32
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	230.155	1.360	139,04	241.425	1.360	133,81	280.939	1.509	135,23
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 27.630	158	174,87	USD 25.597	153	167,57	USD 25.519	157	162,27
Klasse A USD ausschüttend (D)	31.694	406	78,09	31.703	413	76,72	45.070	577	78,14
Klasse A USD ausschüttend (M)	1.328	14	94,20	1.063	11	92,50	4.092	43	94,20
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1.090	13	84,43	591	7	83,54	3.705	43	86,11
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	1.877	21	82,49	1.446	15	82,27	1.651	16	86,35
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	343	586	0,81	383	642	0,81	460	725	0,84
Klasse B USD thesaurierend	12	–	174,10	45	–	167,04	257	2	162,16
Klasse B USD ausschüttend (D)	1.175	15	78,12	1.394	18	76,75	3.478	44	78,17
Klasse C USD thesaurierend	6.402	38	168,99	4.824	30	162,35	6.004	38	158,00
Klasse C USD ausschüttend (D)	3.886	50	78,11	4.319	56	76,74	7.685	98	78,18
Klasse E USD thesaurierend	4.694	29	160,07	4.942	32	153,86	5.720	38	149,90
Klasse E USD ausschüttend (D)	2.873	29	97,61	2.985	31	95,90	4.501	46	97,69
Klasse F USD thesaurierend	1.466	9	157,73	1.138	8	150,68	9.239	64	145,01
Klasse F USD ausschüttend (D)	305	3	93,05	297	3	91,43	454	5	93,15
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)	80	1	99,57	–	–	–	–	–	–
Klasse X GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	–	–	–	149	1	102,86	–	–	–
Klasse Premier USD thesaurierend	8.598	53	162,75	3.034	20	155,28	117.429	787	149,12
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	332	3	103,24	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	12	–	100,22	–	–	–	–	–	–
Klasse LM USD thesaurierend	24.573	143	171,61	23.392	143	163,37	12.444	80	156,16
Klasse LM USD ausschüttend (M)	32.858	381	86,15	38.226	452	84,58	56.026	650	86,13
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	17	–	101,01	41	–	158,41	250	1	154,31
Klasse A (G) USD thesaurierend	304	2	178,40	291	2	170,82	282	2	165,18
Klasse A (G) USD ausschüttend (D)	1.605	21	77,48	1.799	24	76,12	2.194	28	77,54
Klasse L (G) USD thesaurierend	187	1	167,67	249	2	160,96	380	2	156,42
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	1.160	15	77,47	1.257	17	76,12	1.977	26	77,54
Klasse GF USD thesaurierend	180	1	157,88	2.091	14	151,03	2.018	14	145,74
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 3.979	23	171,00	USD 3.984	24	167,11	USD 4.637	27	169,24
Klasse A USD ausschüttend (D)	3.727	35	107,40	3.860	36	107,45	5.218	46	114,10
Klasse A USD ausschüttend (M)	1.604	17	97,16	1.822	19	97,16	3.860	37	103,18
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	64	1	77,64	55	1	78,18	1.498	18	83,76
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	109	1	132,19	247	2	131,27	529	3	137,10
Klasse A EUR ausschüttend (D) (abgesichert)	431	5	75,92	484	6	77,16	657	6	84,48
Klasse A GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	44	–	92,71	48	–	93,65	54	–	101,34
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	117	201	0,81	113	187	0,82	317	475	0,88
Klasse B USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	120	1	161,67
Klasse B USD ausschüttend (D)	2	–	107,29	7	–	107,40	71	1	114,06
Klasse C USD thesaurierend	376	2	157,24	462	3	154,06	515	3	156,80
Klasse C USD ausschüttend (D)	2.265	21	107,32	2.626	24	107,38	2.746	24	114,02
Klasse E USD ausschüttend (D)	1.255	14	91,76	1.521	17	91,81	1.680	17	97,49
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	10	–	94,14	11	–	93,81	12	–	98,69
Klasse E EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	22	–	84,86	21	–	86,24	61	1	94,47
Klasse F USD thesaurierend	168	1	150,00	176	1	146,08	208	1	146,94
Klasse X USD thesaurierend	–	–	–	1	–	113,89	1	–	114,27
Klasse X GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	15	–	89,99	24	–	90,92	27	–	98,39
Klasse Premier USD thesaurierend	135	1	244,55	1.479	6	237,85	646	3	238,65
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	1.168	8	125,69	1.301	9	124,19	1.939	12	128,45
Klasse Premier GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	19	–	80,69	57	1	81,61	71	1	88,31
Klasse A (G) USD thesaurierend	1.170	7	177,76	1.239	7	173,51	1.667	10	175,31
Klasse A (G) USD ausschüttend (D)	1.230	13	96,25	1.280	13	96,30	1.683	16	102,26
Klasse L (G) USD thesaurierend	1.240	7	167,07	1.251	8	163,49	1.271	8	166,02
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	2.093	22	96,25	2.124	22	96,29	2.217	22	102,25
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 1	–	110,80	USD 1	–	105,11	USD 8	–	104,96
Klasse A USD ausschüttend (M)	1	–	99,00	1	–	94,72	1	–	97,66
Klasse LM USD ausschüttend (M)	36.393	367	99,07	37.500	396	94,77	41.350	423	97,71
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 19.790	118	168,38	USD 26.325	160	164,59	USD 32.952	205	160,78
Klasse A USD ausschüttend (D)	11.623	154	75,37	12.816	170	75,55	19.378	250	77,50
Klasse A USD ausschüttend (M)	16.621	199	83,44	17.625	211	83,58	28.475	332	85,73
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	4.599	57	80,31	4.817	59	81,08	13.676	163	84,08
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	10.246	158	96,42	12.124	175	97,83	18.147	229	101,91
Klasse A Euro thesaurierend	2.636	22	109,19	2.860	24	103,14	3.662	32	93,93
Klasse A EUR ausschüttend (D) (abgesichert)	882	10	80,25	621	7	81,69	726	7	86,50
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.632	4.672	0,78	2.394	4.085	0,79	2.683	4.282	0,83
Klasse B USD thesaurierend	153	1	166,38	149	1	162,85	190	1	159,46
Klasse B USD ausschüttend (D)	333	4	75,20	539	7	75,41	659	9	77,38
Klasse C USD thesaurierend	1.683	10	162,40	1.539	10	159,15	1.373	9	156,24
Klasse C USD ausschüttend (D)	7.016	93	75,04	7.344	98	75,22	7.741	100	77,17
Klasse E USD thesaurierend	1.442	10	149,19	1.770	12	146,29	1.709	12	143,77
Klasse E USD ausschüttend (D)	277	3	92,39	229	2	92,60	287	3	95,01
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	109	1	101,11	3	–	100,65	12	–	102,06
Klasse E EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	47	1	79,66	32	–	81,07	34	–	85,73
Klasse F USD thesaurierend	150	1	149,00	311	2	145,16	573	4	140,82
Klasse F USD ausschüttend (D)	961	11	87,75	975	11	87,95	6.045	67	90,42
Klasse X USD thesaurierend	–	–	–	85	1	118,78	83	1	115,32
Klasse X USD ausschüttend (D)	2.280	23	98,29	1.655	17	98,52	–	–	–
Klasse X GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	1.128	11	81,34	762	7	82,35	40	–	86,00
Klasse Premier USD thesaurierend	1.431	7	195,74	2.432	13	190,43	5.511	30	184,28
Klasse Premier USD ausschüttend (M) Plus (e)	5.004	59	84,81	8.811	103	85,21	31.682	360	87,92
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	3.378	25	120,58	5.855	43	119,22	2.541	18	118,86
Klasse Premier GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	33	–	88,46	42	–	89,58	64	–	93,68
Klasse LM USD thesaurierend	–	–	–	1.421	12	113,75	31.642	289	109,55
Klasse A (G) USD thesaurierend	2.736	16	171,07	2.891	17	167,11	3.749	23	163,01
Klasse A (G) USD ausschüttend (D)	USD 2.303	31	75,38	USD 2.409	32	75,56	USD 3.762	49	77,52
Klasse B (G) USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	–	–	77,54
Klasse L (G) USD thesaurierend	619	4	160,81	675	4	157,49	712	5	154,39
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	1.177	16	75,39	1.299	17	75,56	1.861	24	77,53
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fonds									
Klasse A USD thesaurierend	USD 5.148	45	113,86	USD 4.630	41	112,61	USD 4.977	45	111,40
Klasse A USD ausschüttend (D)	485	5	99,41	494	5	98,69	661	7	98,07
Klasse B USD thesaurierend	–	–	–	39	–	106,25	39	–	105,37
Klasse C USD thesaurierend	2.536	24	103,99	2.869	28	103,10	403	4	102,51
Klasse C USD ausschüttend (D)	3.467	36	97,24	1.705	18	96,53	640	7	95,97
Klasse A (G) USD thesaurierend	583	5	113,71	617	5	112,49	710	6	111,51
Klasse A (G) USD ausschüttend (D)	2.308	23	99,27	2.555	26	98,55	3.002	31	97,92

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2019			28. Februar 2019			28. Februar 2018		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fonds (Fortsetzung)									
Klasse L (G) USD thesaurierend	USD 35	–	106,87	USD 35	–	105,99	USD 51	–	105,59
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	301	3	97,01	299	3	96,30	1.154	12	95,93
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fonds									
Klasse A USD thesaurierend	USD 3.593	25	141,56	USD 3.809	28	137,81	USD 3.889	28	138,35
Klasse A USD ausschüttend (A)	5.374	43	123,60	7.235	60	121,27	8.213	67	122,59
Klasse B USD thesaurierend	76	1	99,56	74	1	97,05	55	1	97,68
Klasse C USD thesaurierend	112	1	104,72	505	5	102,20	323	3	103,12
Klasse C USD ausschüttend (A)	707	6	121,07	691	6	118,51	648	5	119,80
Klasse LM USD thesaurierend	25.835	250	103,34	25.026	250	100,10	24.887	250	99,55
Klasse A (G) USD thesaurierend	5	–	147,89	474	3	143,81	501	3	144,09
Klasse A (G) USD ausschüttend (A)	56	–	120,52	55	–	118,37	83	1	119,64
Klasse L (G) USD thesaurierend	131	1	138,74	128	1	135,27	128	1	136,21
Klasse L (G) USD ausschüttend (A)	14	–	111,65	13	–	109,39	52	–	110,57
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 41.402	266	155,65	USD 59.949	404	148,54	USD 48.698	327	149,06
Klasse A USD ausschüttend (D)	10.685	97	110,64	10.842	101	107,40	11.927	107	111,45
Klasse A USD ausschüttend (M)	17.926	176	101,92	13.996	142	98,90	17.853	174	102,62
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	58.152	722	80,59	44.949	570	78,83	59.622	718	83,06
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	26.176	423	91,86	18.510	289	90,32	21.304	287	95,58
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	335	3	97,87	323	3	95,08	1.208	12	98,81
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	16.163	1.293	89,48	8.696	664	87,72	8.530	585	92,33
Klasse A Euro thesaurierend	3.290	13	223,06	1.679	7	205,71	1.321	6	192,38
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	1.880	16	106,23	1.843	16	102,98	16.773	129	106,58
Klasse A EUR ausschüttend (A)	755	6	119,65	870	7	113,99	1.143	9	110,14
Klasse A GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	32	–	90,89	34	–	89,10	37	–	94,24
Klasse A GBP ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	661	4	116,61
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	14.307	1.150	97,50	20.181	1.658	95,53	16.252	1.267	100,38
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1.549	1.476	1,46	2.160	2.091	1,40	2.926	2.740	1,41
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.505	2.469	0,85	1.524	2.479	0,83	1.864	2.792	0,88
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	668	1.018	0,91	137	213	0,87	901	1.332	0,90
Klasse B USD thesaurierend	110	1	151,27	105	1	144,54	372	3	145,42
Klasse B USD ausschüttend (D)	213	2	110,61	227	2	107,38	310	3	111,40
Klasse C USD thesaurierend	2.582	18	146,74	2.501	18	140,40	3.976	28	141,59
Klasse C USD ausschüttend (D)	2.982	27	110,67	3.247	30	107,43	5.566	50	111,48
Klasse E USD thesaurierend	531	4	127,00	568	5	121,57	903	7	122,73
Klasse E USD ausschüttend (D)	223	2	101,71	214	2	98,74	233	2	102,46
Klasse F USD thesaurierend	2.292	16	140,67	2.444	18	133,97	7.950	59	133,90
Klasse F USD ausschüttend (D)	492	5	101,76	477	5	98,78	369	4	102,50
Klasse X USD thesaurierend	–	–	–	1	–	101,82	1	–	101,55
Klasse X USD ausschüttend (M)	2.449	25	97,97	2.708	28	95,06	15.744	160	98,63
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	608	6	96,52	–	–	–
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	172	2	100,17	1.250	11	96,84	471	4	99,67
Klasse Premier USD thesaurierend	50.896	305	167,00	53.625	338	158,85	76.588	484	158,37
Klasse Premier USD ausschüttend (M)	10.595	96	109,94	15.331	144	106,68	16.877	192	88,06
Klasse Premier Euro thesaurierend	105.049	626	152,80	99.919	626	140,43	98.342	618	130,54
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	3.731	29	116,74	5.742	45	112,83	6.556	46	116,00
Klasse Premier EUR ausschüttend (A)	65.721	566	105,57	61.640	537	100,88	54.028	455	97,40
Klasse Premier Euro ausschüttend (M)	10.311	84	112,09	10.005	84	105,09	10.382	84	101,67
Klasse Premier GBP ausschüttend (M)	163	1	125,65	117	1	111,91	84	1	111,98
Klasse LM USD thesaurierend	58.230	329	176,97	55.218	329	167,81	54.729	329	166,31
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fonds									
Klasse A USD thesaurierend	USD 944	8	125,50	USD 912	8	121,11	USD 1.067	9	119,06
Klasse A USD ausschüttend (M)	577	5	106,39	628	6	103,14	454	4	102,50
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	483	4	98,92	16	–	96,90	25	–	98,19
Klasse B USD thesaurierend	324	3	106,72	313	3	103,12	308	3	101,62
Klasse B USD ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	225	2	102,33
Klasse C USD thesaurierend	762	6	119,27	715	6	115,39	787	7	114,00
Klasse C USD ausschüttend (M)	55	1	106,17	100	1	102,93	211	2	102,30
Klasse E USD thesaurierend	474	4	112,68	822	8	109,06	4.013	37	107,86
Klasse E USD ausschüttend (D)	164	2	102,22	1.138	11	99,14	250	3	98,53
Klasse F USD thesaurierend	190	2	124,43	183	2	119,83	179	2	117,33
Klasse X USD ausschüttend (M)	–	–	–	1	–	97,76	1	–	97,20
Klasse Premier USD thesaurierend	1.368	10	134,82	1.316	10	129,66	1.303	10	126,60
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	614	5	102,49	–	–	–	96	1	122,44
Klasse Premier Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	190	2	97,06	194	2	95,58	213	2	97,91
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	106	1	129,49	76	–	125,73	209	1	125,05
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	1.863	15	103,03	2.253	17	100,83	5.910	42	102,08
Klasse S USD ausschüttend (M) Plus (e)	12.467	122	101,91	6.333	64	98,97	4.490	45	98,82
Klasse S Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	2.569	24	96,82	440	4	95,47	281	2	98,20
Klasse S GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	181.571	1.511	98,77	84.941	661	96,82	14.755	109	98,37
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^									
Klasse A USD ausschüttend (A)	USD 55	1	104,46	USD 52	1	99,43	USD 53	1	100,83
Klasse A USD ausschüttend (D)	2.664	22	121,99	2.514	22	115,12	2.594	22	117,15
Klasse X USD thesaurierend	2.947	26	113,67	1.447	14	106,11	184	2	105,57
Klasse Premier USD thesaurierend	99.077	647	153,04	115.046	807	142,65	140.917	996	141,49
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	51.963	422	111,93	49.307	409	105,99	53.879	408	108,34
Anteilsklasse Premier NZD thesaurierend (mit Absicherung)	3.737	56	105,91	3.781	56	99,14	3.983	56	98,63
Klasse LM USD thesaurierend	2.580	24	106,22	–	–	–	–	–	–
Klasse LM CAD thesaurierend (abgesichert)	97.839	1.177	110,68	77.746	989	103,42	–	–	–
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 4.065	29	139,13	USD 409	3	127,85	USD 438	3	125,73
Klasse A USD ausschüttend (D)	–	–	–	1.741	16	109,57	2.418	22	109,79
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	308	2	126,51	423	3	118,12	496	3	119,67
Klasse X USD ausschüttend (D)	–	–	–	1	–	102,06	1	–	102,29
Klasse LM USD thesaurierend	72.635	454	160,04	66.342	454	146,17	64.464	454	142,03
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund									
Klasse A Euro ausschüttend (D)	EUR 182	2	102,85	EUR 177	2	101,21	EUR 269	3	104,04
Klasse Premier Euro thesaurierend	547	5	103,58	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	11	–	100,99	–	–	–	–	–	–
Klasse LM Euro thesaurierend	57.495	327	175,61	65.144	385	169,05	67.186	404	166,34
Klasse LM Euro ausschüttend (Q)	11.235	108	103,70	10.818	106	102,06	10.650	102	104,87
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 1.142.572	8.654	132,03	USD 1.245.618	9.644	129,17	USD 1.694.153	13.090	129,42
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	389.082	3.960	98,26	387.644	3.917	98,97	525.404	5.026	104,54
Klasse A USD ausschüttend (S)	111.689	1.023	109,14	164.019	1.506	108,90	203.722	1.818	112,04
Klasse A AUD thesaurierend (abgesichert)	4.684	69	100,47	2.659	38	98,86	283	4	99,59
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	39.225	589	98,94	27.044	380	100,24	30.385	367	106,47

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2019			28. Februar 2019			28. Februar 2018		
	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 Macro Opportunities Bond Fund^ (Fortsetzung)									
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	USD 25.177	216	115,17	USD 26.798	233	114,74	USD 59.939	476	119,04
Klasse A CNH thesaurierend (mit Absicherung)	2.072	110	134,74	4.627	235	131,96	5.194	251	130,73
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	4.035	264	109,27	4.263	259	110,20	5.228	287	115,13
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	574.304	4.414	118,38	678.424	5.067	117,72	883.641	5.951	121,72
Klasse A EUR ausschüttend (A)	10.698	93	104,55	9.368	80	102,35	11.039	93	97,40
Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	34.490	321	97,86	–	–	–	–	–	–
Klasse A Euro ausschüttend (S) (abgesichert)	27.575	242	103,59	34.699	290	105,10	44.137	324	111,62
Klasse A GBP thesaurierend	830	4	156,19	1.488	8	140,33	1.409	8	135,48
Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)	93.048	619	123,44	55.357	343	121,84	56.197	328	124,43
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	26.363	232	93,27	20.864	166	94,97	17.965	128	102,26
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	4	–	98,66	–	–	–	–	–	–
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus (e)	4	–	97,82	–	–	–	–	–	–
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	58.021	5.261	108,25	63.285	5.428	107,68	52.362	3.896	111,39
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	28.676	31.409	1,27	38.168	41.450	1,24	49.675	52.233	1,26
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	79.708	114.245	0,97	53.142	73.347	0,98	69.053	87.519	1,05
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	–	–	0,96
Klasse B USD thesaurierend	663	6	119,62	733	6	117,17	1.093	9	117,81
Klasse C USD thesaurierend	77.461	645	120,16	84.384	716	117,85	93.546	788	118,68
Klasse C USD ausschüttend (S)	11.523	107	107,98	13.618	126	107,76	16.268	147	110,85
Klasse A NOK thesaurierend (mit Absicherung)	892	83	97,54	723	64	96,30	268	22	98,25
Klasse E USD thesaurierend	44.480	374	118,83	45.442	390	116,61	55.098	469	117,54
Klasse E USD ausschüttend (S)	4.811	45	107,68	5.705	53	107,46	6.255	57	110,54
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	12.210	103	107,81	12.631	103	107,53	13.536	99	111,84
Klasse F USD thesaurierend	170.782	1.372	124,49	160.329	1.319	121,54	184.920	1.525	121,30
Klasse F USD ausschüttend (S)	21.771	197	110,59	23.485	213	110,33	33.792	298	113,53
Klasse X USD thesaurierend	303.764	2.307	131,64	298.902	2.327	128,46	379.862	2.966	128,08
Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	72.836	710	102,60	71.346	692	103,08	31.168	288	108,34
Klasse X USD ausschüttend (S)	18.197	167	108,82	17.550	162	108,56	59.637	534	111,70
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)	42.545	359	117,35	42.944	368	116,61	49.006	384	120,43
Klasse X EUR thesaurierend	13.668	82	151,90	5.143	32	143,30	24.434	150	133,37
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	252.774	1.888	121,85	276.085	2.008	120,86	385.041	2.538	124,35
Klasse X EUR ausschüttend (A) (mit Absicherung)	15.999	149	97,58	17.946	156	100,87	34.699	268	106,13
Klasse X EUR ausschüttend (M) (mit Absicherung)	7.766	71	99,08	8.113	71	100,57	7.411	56	107,74
Klasse X GBP thesaurierend	7.174	37	160,18	5.980	31	143,38	7.658	40	137,82
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)	114.101	739	126,89	126.647	763	125,13	152.630	872	127,18
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	8.605	72	98,21	8.385	63	99,74	7.258	49	106,85
Klasse X SGD thesaurierend (abgesichert)	4.177	4.454	1,30	2.746	2.911	1,28	5.010	5.167	1,28
Klasse Premier USD thesaurierend	472.569	3.449	137,03	520.945	3.899	133,62	1.141.369	8.581	133,02
Klasse Premier USD ausschüttend (S)	90.976	838	108,58	64.386	594	108,32	61.865	555	111,46
Klasse Premier AUD thesaurierend (mit Absicherung)	2.902	41	104,04	2.997	41	102,03	4.264	54	102,07
Klasse Premier AUD ausschüttend (S) (mit Absicherung)	45.297	609	110,37	53.297	678	110,76	70.798	795	114,65
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	160.296	4.417	150,29	187.702	4.862	145,01	550.102	12.618	141,55
Klasse Premier CHF, thesaurierend (Abgesichert)	23.712	210	111,82	31.032	279	111,04	38.662	319	114,46
Klasse Premier CHF ausschüttend (S) (abgesichert)	10.786	106	100,32	12.050	118	101,95	13.635	119	108,54
Klasse Premier Euro thesaurierend	15.192	88	157,53	6.567	39	148,41	11.053	66	137,89
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	786.401	5.996	119,33	877.414	6.522	118,27	1.147.017	7.738	121,50
Klasse Premier EUR ausschüttend (S) (mit Absicherung)	76.296	680	102,09	77.615	659	103,56	91.749	684	109,98
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	313.468	2.165	118,97	374.134	2.406	117,24	470.204	2.871	118,95
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	359.007	3.081	95,75	307.196	2.384	97,17	273.792	1.913	103,95
Klasse Premier JPY thesaurierend (abgesichert)	91.592	873	11.150,51	84.544	854	11.035,98	21.182	200	11.300,32
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	4.511	177	101,37	3.925	149	99,51	2.886	99	100,19
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)	7.280	643	111,10	7.443	624	110,14	11.084	811	113,25
Klasse S USD thesaurierend	28.657	204	140,21	41.131	301	136,44	64.589	477	135,28
Klasse S Euro thesaurierend (abgesichert)	199.417	1.413	128,40	225.498	1.561	127,00	265.051	1.672	129,94
Klasse LM USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	385	3	121,82
Klasse LM AUD ausschüttend (S) (mit Absicherung)	43.203	608	105,53	56.143	748	105,86	65.710	772	109,64
Klasse LM Euro thesaurierend	1.696	12	131,67	1.546	11	123,42	1.870	14	113,42
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^									
Klasse A USD ausschüttend (D)	USD 56	1	89,99	USD 59	1	94,77	USD 57	1	114,03
Klasse Premier USD thesaurierend	33.408	287	116,38	33.791	287	117,71	207.992	1.599	130,07
Klasse LM USD ausschüttend (M)	1.618	20	81,41	1.633	19	85,70	1.797	17	103,13
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 24	–	111,56	USD 23	–	106,76	USD 23	–	106,93
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1	–	97,81	3	–	96,12	87	1	102,07
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	104	1	103,39	104	1	100,52	182	1	103,80
Klasse C USD thesaurierend	1	–	111,15	1	–	106,43	1	–	106,80
Klasse E USD thesaurierend	1	–	111,15	1	–	106,43	1	–	106,80
Klasse F USD thesaurierend	4.984	44	113,70	4.756	44	108,48	1	–	108,06
Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	852	8	102,62
Klasse X CHF ausschüttend (M) (abgesichert)	67	1	91,13	66	1	90,64	4.269	41	98,31
Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	2.548	21	97,91
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	1.060	9	103,44	–	–	–	–	–	–
Klasse LM AUD thesaurierend (abgesichert)	29.007	400	107,77	17.913	245	102,89	–	–	–
Klasse LM Euro thesaurierend (abgesichert)	23.158	212	99,39	–	–	–	–	–	–
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	679.990	4.631	120,67	706.649	4.603	115,75	401.557	2.506	116,39
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^									
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	USD 10	–	92,32	USD 100	1	92,57	USD 103	1	98,44
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	12	–	94,18	97	1	94,39	111	1	100,12
Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)	11	–	90,30	97	1	92,25	111	1	98,94
Klasse X EUR ausschüttend (A) (mit Absicherung)	–	–	–	11	–	93,12	12	–	99,86
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–	–	–	394	3	91,26	219	2	98,32
Klasse Premier USD thesaurierend	3.753	36	105,22	1.103	11	103,43	400	4	105,63
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	351	3	96,79	592	5	96,61	1.623	13	101,74
Klasse Premier JPY thesaurierend (abgesichert)	5.517	60	9.768,30	5.245	60	9.743,84	5.758	60	10.239,36
Klasse Premier JPY ausschüttend (S) (abgesichert)	43.434	495	9.318,24	41.813	495	9.412,17	46.969	495	10.120,39
Klasse S USD ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	381	4	101,72
Klasse S GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–	–	–	22	–	93,53	7.033	51	100,41
Klasse LM USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	32.440	305	106,45
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^									
Klasse D AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 81	1	100,46	USD 84	1	98,49	USD –	–	–
Klasse D Euro thesaurierend (abgesichert)	1.508	13	104,54	1.815	16	100,56	–	–	–
Klasse D Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	3.580	33	98,69	1.884	17	97,34	–	–	–
Klasse D USD thesaurierend	19.742	178	110,86	23.357	223	104,95	1.001	10	100,29
Klasse D USD ausschüttend (M)	8.085	79	102,83	12.231	122	99,86	300	3	99,91
Klasse D USD ausschüttend (M) Plus	2.023	20	101,15	1.974	20	98,71	–	–	–
Klasse M CHF thesaurierend (abgesichert)	1.055	10	104,77	601	6	100,64	–	–	–
Klasse M GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	973	8	100,00	1.040	8	98,04	–	–	–
Klasse F USD thesaurierend	1.049	9	113,24	5.458	51	107,11	1.380	13	102,20
Klasse M USD ausschüttend (M)	797	8	102,40	752	8	99,43	–	–	–
Klasse M Euro thesaurierend (abgesichert)	59	1	106,81	196	2	102,50	611	5	100,17
Klasse Premier USD thesaurierend	500.030	3.646	137,16	381.663	2.951	129,35	366.093	2.984	122,69
Klasse Premier USD ausschüttend (Q)	9.364	89	104,63	7.494	74	101,67	4.199	41	101,42

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2019			28. Februar 2019			28. Februar 2018		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ (Fortsetzung)									
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	USD 418.936	2.999	127,08	USD 200.844	1.451	121,71	USD 57.644	398	118,82
Klasse Premier Euro ausschüttend (Q) (abgesichert)	26.212	239	99,80	19.616	175	98,51	495	4	101,08
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	39.399	327	98,92	34.877	270	97,31	–	–	–
Klasse LM USD thesaurierend	513.886	3.653	140,66	482.993	3.652	132,25	498.772	4.000	124,69
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^									
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	USD 11	–	94,67	USD 10	–	92,16	USD 10	–	92,92
Klasse Premier USD thesaurierend	202	2	101,08	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	1.060	9	103,53	–	–	–	–	–	–
Klasse LM USD thesaurierend	939.391	8.542	109,98	893.928	8.542	104,66	947.320	9.374	101,06
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 5.438	46	117,30	USD 4.611	43	107,20	USD 4.257	41	105,08
Klasse Premier USD thesaurierend	16.722	160	104,51	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	341	3	108,35	–	–	–	–	–	–
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	89.324	638	115,07	112.071	800	105,65	115.040	800	104,49
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 27.725	187	148,22	USD 36.078	247	145,82	USD 58.032	374	155,36
Klasse A USD ausschüttend (M)	2.563	26	97,47	2.740	28	97,20	3.327	31	106,18
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	2	–	99,42	–	–	–	–	–	–
Klasse A USD ausschüttend (S)	60.632	504	120,35	56.302	469	120,00	64.460	493	130,69
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.243	23	79,89	392	7	80,68	347	5	89,73
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	617	6	89,37	43.370	427	89,39	68.062	567	98,37
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)	102.651	605	154,36	65.247	378	151,68	93.847	488	157,73
Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)	857	10	80,43	877	9	82,56	670	6	92,53
Klasse A EUR ausschüttend (S)	76	1	97,44	77	1	93,88	86	1	95,32
Klasse A EUR ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	13.632	114	108,70	15.251	124	108,28	26.149	186	115,10
Klasse A GBP thesaurierend	105	1	109,89	103	1	99,19	–	–	–
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	483	5	84,48	531	5	85,15	562	4	94,97
Klasse A GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	7.393	52	117,09	8.505	55	115,98	20.410	122	121,94
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	4	–	99,62	–	–	–	–	–	–
Klasse A SGD thesaurierend	131	173	1,05	140	186	1,01	1.185	1.479	1,06
Klasse B USD thesaurierend	72	1	135,46	130	1	133,44	203	1	142,51
Klasse B USD ausschüttend (S)	324	3	120,33	322	3	119,97	815	6	130,66
Klasse C USD thesaurierend	1.188	9	131,62	1.115	9	129,82	2.296	17	139,01
Klasse C USD ausschüttend (S)	4.276	36	119,76	5.542	46	119,42	6.455	50	130,05
Klasse E USD thesaurierend	1.915	19	100,74	2.291	23	99,42	3.495	33	106,56
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	39	–	92,50	41	–	92,77	91	1	102,75
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert) (IH)	2.893	24	111,53	3.587	29	109,95	5.807	41	115,03
Klasse F USD thesaurierend	3.006	29	104,24	3.225	32	102,34	2.724	25	108,60
Klasse F USD ausschüttend (S)	109	1	88,82	107	1	88,55	163	2	96,44
Klasse R USD ausschüttend (S)	76	1	88,73	125	1	88,46	136	1	96,34
Klasse R GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	5.211	44	96,58	5.966	47	95,65	14.219	103	100,57
Klasse X USD thesaurierend	13.383	128	104,26	17.085	167	102,31	20.224	186	108,46
Klasse X USD ausschüttend (S)	512	6	89,26	607	7	88,99	651	7	96,92
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	5.932	56	96,12	92.473	848	95,89	79.144	618	104,97
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)	15.248	134	103,31	19.599	170	101,27	17.858	140	104,75
Klasse X EUR ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1.436	14	95,91	2.473	23	95,58	2.277	18	100,99
Klasse X GBP thesaurierend	95.420	597	131,29	121.124	772	118,22	139.861	841	120,75
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)	11.168	96	95,73	8.469	67	94,93	6.306	45	102,73
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)	5.072	39	106,59	5.427	39	103,94	2.923	20	106,40
Klasse X GBP ausschüttend (S) (abgesichert)	31.496	309	83,87	34.251	306	84,48	22.615	175	93,91
Klasse X GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	35.623	296	98,86	54.794	422	97,92	36.578	258	102,95
Klasse Premier USD thesaurierend	144.834	1.200	120,66	142.026	1.200	118,31	152.120	1.215	125,24
Klasse Premier USD ausschüttend (S)	12.311	134	92,10	10.558	115	91,82	13.024	130	100,00
Klasse Premier Euro thesaurierend	27.421	166	150,58	41.806	257	142,76	79.338	461	141,00
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	62.658	613	93,06	28.457	270	92,74	87.471	707	101,41
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)	69.388	489	129,22	77.022	535	126,59	125.313	785	130,81
Klasse Premier EUR ausschüttend (S)	1.610	15	100,48	1.644	15	96,79	1.926	16	98,28
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	12.677	124	83,81	15.474	138	84,46	10.936	84	94,20
Klasse Premier GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	17.486	135	106,71	11.026	79	105,65	16.873	110	111,04
Klasse LM USD thesaurierend	3.076	30	101,49	–	–	–	183	1	133,80
Klasse LM USD thesaurierend (abgesichert) (IH)	132.280	1.138	116,21	124.224	1.111	111,77	127.946	1.148	111,42
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 23.273	212	109,86	USD 25.225	221	114,01	USD 32.092	267	120,09
Klasse A USD ausschüttend (A)	11.041	120	91,85	11.561	118	97,91	12.355	118	105,11
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	378	4	92,74	977	9	97,81	4.961	38	106,28
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	–	–	87,78	1	–	92,62	2	–	100,75
Klasse A SGD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	7.833	10.309	1,01
Klasse B USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	42	–	104,57
Klasse C USD thesaurierend	115	1	96,87	120	1	100,79	198	2	106,70
Klasse E USD thesaurierend	477	5	96,33	704	7	100,28	479	5	106,26
Klasse E USD ausschüttend (A)	330	4	93,25	330	3	99,11	805	8	106,41
Klasse F USD thesaurierend	2.861	29	100,19	3.209	31	103,76	9.965	92	108,86
Klasse F USD ausschüttend (A)	31	–	90,57	33	–	96,75	2.103	20	103,18
Klasse X USD thesaurierend	58	1	92,29	659	7	95,61	–	–	–
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	10	–	88,30	12	–	92,87	–	–	–
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)	2.422	21	96,32	2.769	21	100,74	3.051	21	107,80
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	526	5	86,47	280	2	91,92	1.666	12	101,49
Klasse Premier USD thesaurierend	163.088	1.576	103,48	189.466	1.770	107,07	203.609	1.816	112,10
Klasse Premier USD ausschüttend (A)	10.093	111	90,54	10.710	111	96,80	8.167	79	103,91
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	111.253	976	103,77	165.190	1.332	109,06	199.222	1.386	117,81
Klasse Premier Euro ausschüttend (A) (abgesichert)	53.985	621	79,04	69.294	709	85,96	85.632	738	95,10
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	30.594	300	83,94	39.623	335	89,24	45.289	334	98,48
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)	437	48	88,91	488	48	93,52	1.290	105	101,63
Klasse Premier SGD thesaurierend (abgesichert)	187.549	248.517	1,05	200.035	248.517	1,09	254.077	292.575	1,15
Klasse LM USD thesaurierend	120.468	1.131	106,54	164.148	1.496	109,73	279.372	2.454	113,86
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	285.321	3.149	134,53	300.802	3.043	139,37	100.297	889	145,29
Klasse LM Euro thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	18.392	126	119,42
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	22.795	161	106,65	64.706	416	112,87
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 4.498	40	112,12	USD 3.966	37	108,61	USD 2.559	23	109,25
Klasse A USD ausschüttend (D)	591	6	98,23	216	2	97,34	220	2	102,87
Klasse F USD ausschüttend (D)	503	5	100,27	–	–	–	29	–	102,86
Klasse Premier USD thesaurierend	2.238	17	135,53	3.962	30	130,83	3.882	30	130,67
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	1.962	13	127,98
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)	20	–	135,79	21	–	131,13	22	–	131,20
Klasse LM USD thesaurierend	–	–	–	80.679	720	112,05	80.151	720	111,32
Klasse S CAD thesaurierend (abgesichert) (IH)	8.973	92	129,31	8.720	92	124,22	8.466	88	123,04
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund^*									
Klasse A USD thesaurierend	USD 28.763	244	117,75	USD 28.381	246	115,41	USD 25.700	209	123,13
Klasse A USD ausschüttend (M)	14.014	130	107,63	13.531	126	107,00	14.577	124	117,24

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2019			28. Februar 2019			28. Februar 2018		
	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 Opportunistic Fixed Income Fund^* (Fortsetzung)									
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	USD 19	–	90,38	USD 19	–	90,01	USD 181	2	98,73
Klasse A SGD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	2.596	3.375	1,02
Klasse C USD thesaurierend	1.444	13	109,17	1.511	14	107,27	959	8	115,02
Klasse E USD thesaurierend	2.486	23	107,18	2.658	25	105,38	3.455	31	113,10
Klasse F USD thesaurierend	2.093	21	101,68	2.162	22	99,45	3.190	30	105,69
Klasse F USD ausschüttend (M)	841	9	92,24	868	9	91,69	920	9	100,47
Klasse X USD thesaurierend	293	3	105,89	286	3	103,52	305	3	109,90
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	41	–	85,55	46	–	85,94	16	–	96,15
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	3	–	103,73	4	–	102,42	–	–	–
Klasse Premier USD thesaurierend	286.202	2.344	122,12	344.914	2.891	119,30	291.199	2.303	126,46
Klasse Premier USD thesaurierend (abgesichert) (IH)	2.294	20	114,25	2.204	20	109,81	14.132	128	110,77
Klasse Premier USD ausschüttend (M)	–	–	–	8.065	86	93,26	34	–	102,19
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	6.470	47	113,84
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	5.378	45	98,70	3.571	28	97,50	2.879	20	103,15
Klasse Premier NZD thesaurierend (abgesichert) (IH)	17.449	180	153,87	18.214	180	148,65	19.408	180	149,77
Klasse LM USD thesaurierend	30.635	276	110,91	40.400	374	107,99	87.085	766	113,72
Klasse LM Euro thesaurierend	6.130	49	113,94	5.445	45	107,20	6.642	52	105,27
Klasse LM NZD thesaurierend (abgesichert) (IH)	182.434	1.633	177,35	179.551	1.544	170,77	180.179	1.461	170,96
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 167	2	99,63	USD 166	2	98,81	USD 103	1	106,22
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	5	–	100,44	–	–	–	–	–	–
BW Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)	70.243	1.000	104,30	–	–	–	–	–	–
BW Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)	230.959	1.311	144,82	418.149	2.342	134,64	789.441	4.187	136,95
BW Klasse LM GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	717.869	5.183	113,82	742.293	5.183	107,98	1.270.520	8.091	114,06
Klasse BW Premier EUR thesaurierend (abgesichert) (IH)	263.564	2.284	104,98	240.311	2.090	101,11	80.596	651	101,43
Klasse BW Premier GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)	158.625	855	152,53	302.835	1.605	142,28	443.071	2.220	144,99
Klasse BW Premier GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	182.314	1.313	114,11	188.533	1.313	108,25	430.916	2.737	114,35
Klasse BW Premier USD thesaurierend	1	–	121,00	1	–	119,05	1	–	125,96
Klasse BW Premier USD thesaurierend (abgesichert) (IH)	20.918	203	103,30	20.441	203	100,94	–	–	–
Klasse X USD thesaurierend	1	–	104,24	1	–	102,91	1	–	109,58
Klasse Premier USD thesaurierend	34.123	333	102,40	33.680	333	101,07	35.862	333	107,62
Klasse Premier USD ausschüttend (M) Plus (e)	5	–	100,69	–	–	–	–	–	–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 4.431	34	131,10	USD 2.016	17	119,89	USD 1.637	14	119,23
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	13.202	135	97,60	19.359	213	90,75	27.766	293	94,72
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	8.101	70	105,09	9.549	86	97,65	12.959	106	100,05
Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)	16.572	154	97,91	16.258	152	94,05	16.623	137	99,31
Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	13.224	135	89,34	14.255	148	84,40	18.365	166	90,80
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	682	6	93,28	817	7	87,59	969	8	93,15
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	423	566	1,04	49	69	0,97	86	112	1,02
Klasse C USD ausschüttend (D)	61	1	106,48	30	–	98,36	30	–	101,16
Klasse E USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	23	–	100,10
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	1	–	103,55	1	–	96,45	1	–	99,22
Klasse F USD ausschüttend (D)	1.074	10	103,26	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD ausschüttend (D)	232	2	103,45	481	5	95,60	186	2	98,27
Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	523	5	100,26	407	4	92,96	1.289	13	96,50
Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3.635	36	92,21	3.607	37	86,86	8.370	74	92,95
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1.255	11	96,49	2.221	19	90,37	4.402	33	95,59
Klasse Premier USD ausschüttend (M) Plus (e)	554	5	102,12	492	5	94,61	490	5	98,06
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	9.625	76	114,56	9.303	77	106,06	2.641	20	107,87
Klasse Premier Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	2.113	21	93,20	2.554	26	87,74	16.198	142	93,77
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	215	2	96,79	219	2	90,56	163	1	95,63
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)	3.692	317	114,26	5.967	521	105,75	33.404	2.570	107,70
Klasse S Euro thesaurierend (abgesichert)	9.929	86	105,49	9.253	83	97,60	–	–	–
Klasse S Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	4.086	36	104,63	2.456	22	98,42	–	–	–
Klasse S GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3.033	25	99,65	3.127	25	93,18	3.592	26	98,57
Klasse LM AUD ausschüttend (Q) (mit Absicherung)	203	3	103,79	195	3	96,35	210	3	99,75
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 412	4	113,72	USD 806	7	109,05	USD 307	3	108,17
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	5	–	104,42	8	–	101,75	219	2	103,97
Klasse Premier USD thesaurierend	27.944	238	117,63	29.466	262	112,42	35.475	320	110,80
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	2.729	99	103,94	3.032	99	99,82
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	398	3	110,16	418	3	106,29	436	3	106,65
Klasse LM USD thesaurierend	10.942	88	124,56	10.397	88	118,35	17.608	153	115,31
Klasse S BRL thesaurierend (abgesichert)	2.632	103	105,95	–	–	–	–	–	–
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^									
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	USD 11	–	95,23	USD 11	–	93,53	USD 11	–	99,54
Klasse S EUR ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	10.407	100	94,69	10.914	100	95,96	24.651	200	101,03
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 10	–	93,18	USD 11	–	103,75	USD –	–	–
Klasse X USD thesaurierend	9	–	93,94	11	–	104,19	–	–	–
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	9	–	86,55	11	–	100,26	–	–	–
Klasse Premier USD thesaurierend	3.333	35	94,09	1.067	10	104,27	–	–	–
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	9	–	90,88	11	–	102,47	–	–	–
Klasse LM AUD thesaurierend (abgesichert)	301.076	4.740	94,32	351.762	4.740	104,62	–	–	–
Klasse LM SGD thesaurierend (abgesichert)	65.335	96.260	0,94	10	14	1,04	–	–	–
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 155	1	128,36	USD 208	2	131,29	USD 66	1	131,59
Klasse Premier USD thesaurierend	376	3	132,91	676	5	135,28	672	5	134,31
Klasse S USD thesaurierend	1.868	16	116,27	1.900	16	118,20	1.881	16	117,06
Klasse S Euro thesaurierend (abgesichert)	931	7	124,24	1.947	13	128,32	2.129	13	130,80
Legg Mason ClearBridge Value Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 17.004	155	109,66	USD 15.603	144	108,62	USD 20.444	186	109,89
Klasse A USD ausschüttend (A)	23.966	115	208,35	25.581	124	206,36	30.241	145	208,79
Klasse A Euro thesaurierend	326	2	126,33	1.881	14	121,00	3.005	22	114,18
Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)	24	–	108,90	25	–	109,57	28	–	114,30
Klasse A GBP ausschüttend (A)	29	–	162,01	29	–	147,22	29	–	143,50
Klasse A SGD thesaurierend	2.338	3.434	0,94	2.408	3.570	0,91	2.678	3.924	0,90
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	561	436	1,79	640	487	1,78	429	313	1,82
Klasse B USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	111	1	117,03
Klasse B USD ausschüttend (A)	59	1	102,03	–	–	–	–	–	195,41
Klasse C USD thesaurierend	1.171	10	112,42	1.307	12	111,64	1.455	13	113,51
Klasse C USD ausschüttend (A)	2.413	13	191,34	2.576	14	190,01	3.075	16	193,20
Klasse F USD thesaurierend	2.069	10	214,20	1.978	9	211,51	394	2	212,72
Klasse F USD ausschüttend (A)	175	1	119,36	182	2	117,98	73	1	118,68
Klasse X USD ausschüttend (A)	1.562	10	149,31	1.582	11	147,63	1.720	12	148,48
Klasse Premier USD thesaurierend	291.420	1.520	191,73	287.897	1.524	188,92	281.480	1.488	189,19
Klasse Premier USD ausschüttend (A)	139	1	133,33	312	2	132,05	436	3	132,80

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2019			28. Februar 2019			28. Februar 2018		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason ClearBridge Value Fund (Fortsetzung)									
Klasse Premier Euro thesaurierend	USD 160	1	160,86	USD 471	3	153,06	USD 273	2	142,83
Galleon Klasse	–	–	–	28	–	140,85	28	–	141,65
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 672	7	94,04	USD 754	7	100,67	USD 1.392	12	116,46
Klasse A USD ausschüttend (A)	337	3	102,33	374	3	110,67	562	4	128,56
Klasse C USD thesaurierend	113	1	91,70	144	1	98,42	167	1	114,42
Klasse C USD ausschüttend (A)	63	1	100,15	68	1	108,03	80	1	125,66
Klasse Premier USD thesaurierend	1.014	10	100,54	15.958	149	107,14	22.547	184	122,81
Klasse LM USD thesaurierend	13.383	146	91,50	14.761	152	97,10	15.544	141	110,44
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 37.075	166	222,76	USD 34.723	168	206,53	USD 45.963	233	197,40
Klasse A USD ausschüttend (A)	14.550	65	222,60	16.128	78	206,38	19.950	101	197,23
Klasse A Euro thesaurierend	2.536	8	296,86	4.555	15	265,98	30.514	106	236,99
Klasse B USD thesaurierend	572	3	204,51	574	3	190,09	1.391	8	182,51
Klasse B USD ausschüttend (A)	1.067	5	209,43	1.258	6	194,67	1.499	8	186,94
Klasse C USD thesaurierend	17.815	87	204,49	18.119	95	190,07	18.630	102	182,58
Klasse C USD ausschüttend (A)	19.797	95	209,37	24.665	127	194,61	35.228	188	186,94
Klasse E USD thesaurierend	15.760	66	239,24	14.450	65	222,65	16.132	75	214,42
Klasse E USD ausschüttend (A)	909	4	239,37	915	4	222,78	1.026	5	214,54
Klasse F USD thesaurierend	20.515	100	205,19	18.458	97	189,66	12.119	67	180,20
Klasse F USD ausschüttend (A)	2.375	9	273,65	1.810	7	253,74	7.005	29	241,66
Klasse X USD ausschüttend (A)	10.834	61	176,91	11.507	70	164,05	13.158	84	156,24
Klasse X EUR thesaurierend	150	1	222,92	209	1	199,06	199	1	176,29
Klasse Premier USD thesaurierend	4.365	16	279,29	3.542	14	257,66	12.417	51	243,85
Klasse Premier USD ausschüttend (A)	3.464	10	330,29	3.251	11	306,76	3.549	12	292,10
Klasse Premier Euro thesaurierend	29.916	85	318,77	27.598	85	284,15	37.546	123	250,68
Klasse LM USD thesaurierend	10.609	71	150,46	2.571	19	138,36	979	8	130,16
Klasse LM Euro thesaurierend	3.140	18	155,69	2.894	18	138,34	3.314	22	121,30
Klasse A (G) USD thesaurierend	4.372	19	231,31	4.579	21	214,08	5.049	25	203,91
Klasse B (G) USD thesaurierend	4	–	217,36	6	–	201,68	12	–	193,09
Klasse L (G) USD thesaurierend	3.885	18	217,48	3.764	19	201,78	3.716	19	193,16
Klasse GA USD thesaurierend	3.887	17	233,34	3.693	17	216,13	3.687	18	206,22
Klasse GA Euro thesaurierend	354	1	305,33	346	1	273,27	401	1	243,08
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	635	2	304,29	625	2	272,33	613	2	242,26
Klasse GE USD thesaurierend	177	1	219,38	165	1	203,99	185	1	196,10
Klasse GE Euro thesaurierend	50	–	286,76	46	–	257,63	44	–	230,91
Klasse GP USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	7	–	226,94
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 241.280	822	293,54	USD 241.848	875	276,38	USD 212.644	830	256,18
Klasse A USD ausschüttend (A)	40.461	138	293,68	41.887	151	276,51	40.967	160	256,25
Klasse A Euro thesaurierend	89.087	189	429,27	86.866	196	390,56	65.540	159	337,56
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	8.548	49	158,81	11.494	67	151,80	40.188	227	145,07
Klasse A EUR ausschüttend (A)	–	–	–	38	–	109,63	–	–	–
Klasse B USD thesaurierend	384	1	271,86	529	2	256,61	1.160	5	239,04
Klasse B USD ausschüttend (A)	128	–	276,01	120	–	260,54	320	1	242,70
Klasse C USD thesaurierend	18.746	69	271,95	19.575	76	256,71	15.279	64	239,13
Klasse C USD ausschüttend (A)	12.889	47	276,06	39.719	152	260,59	35.688	147	242,75
Klasse E USD thesaurierend	18.235	112	162,42	14.742	96	153,52	15.641	109	143,36
Klasse E USD ausschüttend (A)	1.251	8	157,52	1.720	12	148,89	2.367	17	139,04
Klasse F USD thesaurierend	88.874	565	157,21	79.268	537	147,57	59.361	437	135,96
Klasse F USD ausschüttend (A)	22.417	143	156,88	19.654	133	147,26	16.874	124	135,67
Klasse U USD thesaurierend	206.925	1.768	117,02	318.493	2.907	109,57	–	–	–
Klasse U Euro thesaurierend	125.516	872	130,96	103.769	770	118,49	–	–	–
Klasse X USD thesaurierend	51.566	293	175,85	54.938	333	165,05	66.049	434	152,03
Klasse X EUR thesaurierend	4.563	33	125,34	2.343	18	113,70	206	2	97,69
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	14.202	92	141,08	6.523	43	134,46	26.278	169	127,72
Klasse X EUR ausschüttend (A) (mit Absicherung)	1.654	10	150,52	1.631	10	143,42	1.661	10	136,11
Klasse X GBP thesaurierend	1.760	7	194,61	570	3	167,52	261	1	148,61
Klasse Premier USD thesaurierend	236.660	1.289	183,65	273.110	1.587	172,06	364.904	2.311	157,93
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	3.773	130	120,11	3.367	114	111,29	3.080	100	99,94
Klasse Premier Euro thesaurierend	15.897	92	157,62	410	3	142,58	348	2	122,06
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	33.265	195	155,56	23.769	141	147,88	22.711	133	139,86
Klasse Premier GBP thesaurierend	2.738	12	195,13	4.004	18	167,83	4.428	22	148,48
Klasse LM USD thesaurierend	71.600	428	167,15	83.007	532	156,11	327	2	142,40
Klasse LM Euro thesaurierend	732	4	172,93	687	4	156,06	783	5	132,70
Klasse A (G) USD thesaurierend	8.104	27	304,08	7.980	28	285,80	8.146	31	263,98
Klasse B (G) USD thesaurierend	3	–	286,08	3	–	269,46	8	–	250,04
Klasse L (G) USD thesaurierend	8.972	31	285,86	8.578	32	269,36	8.877	36	250,04
Klasse GA USD thesaurierend	1.680	5	361,93	1.731	5	340,46	1.889	6	315,00
Klasse GA Euro thesaurierend	271	1	420,07	255	1	381,82	235	1	329,36
Klasse GE USD ausschüttend (A)	7	–	338,15	7	–	319,34	6	–	297,77
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 135.200	711	190,16	USD 186.764	951	196,43	USD 297.762	1.526	195,14
Klasse A USD ausschüttend (A)	33.089	174	190,28	42.369	216	196,55	59.443	305	195,18
Klasse A AUD thesaurierend (abgesichert)	10.192	100	151,63	14.264	128	157,64	22.327	182	157,88
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	228	2	103,79	237	2	109,08	35	–	111,94
Klasse A CNH thesaurierend (mit Absicherung)	448	26	124,87	758	39	129,30	4	–	126,48
Klasse A Euro thesaurierend	19.554	64	279,59	23.525	74	279,08	32.039	102	258,53
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	30.720	201	139,13	19.792	119	146,05	3.438	19	149,59
Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)	12	–	100,61	399	3	105,87	538	4	108,51
Klasse A GBP thesaurierend	855	5	147,81	988	5	140,07	2.036	11	134,04
Klasse A HKD thesaurierend	1.906	130	114,85	1.901	125	118,92	3.025	201	117,89
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	33	2	147,13	43	3	154,65	91	5	159,09
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1.824	1.592	1,59	2.446	2.005	1,65	2.966	2.374	1,65
Klasse B USD thesaurierend	1.564	8	186,50	1.731	9	193,15	3.827	20	192,85
Klasse B USD ausschüttend (A)	1.520	8	178,81	1.849	10	185,18	3.031	16	184,88
Klasse C USD thesaurierend	11.687	63	186,54	14.764	76	193,19	17.556	91	192,88
Klasse C USD ausschüttend (A)	18.063	101	178,81	31.683	171	185,18	40.704	220	184,88
Klasse E USD thesaurierend	15.456	83	186,27	18.726	97	193,15	30.452	158	193,33

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2019			28. Februar 2019			28. Februar 2018		
	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 E USD ausschüttend (A)	USD 1.578	8	186,30	USD 2.148	11	193,18	USD 3.018	16	193,36
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	229	2	119,71	281	2	126,19	431	3	130,26
Klasse F USD thesaurierend	14.168	68	209,59	19.799	92	215,84	42.344	199	213,14
Klasse F USD ausschüttend (A)	2.499	12	209,74	2.664	12	215,99	3.611	17	213,29
Klasse X USD thesaurierend	25.330	169	150,20	35.409	229	154,64	44.203	290	152,63
Klasse X USD ausschüttend (A)	6.466	39	166,95	11.479	67	171,88	23.117	136	169,65
Klasse X EUR thesaurierend	1.573	9	156,68	1.807	10	155,88	618	4	143,48
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	3.233	26	114,34	4.635	34	119,67	1.206	8	121,84
Klasse X GBP thesaurierend	44.678	186	197,41	67.134	271	186,50	161.773	662	177,40
Klasse Premier USD thesaurierend	468.518	1.890	247,93	490.790	1.926	254,80	512.285	2.044	250,61
Klasse Premier USD ausschüttend (A)	39	–	100,22	147	1	103,40	90	1	101,54
Klasse Premier Euro thesaurierend	3.160	11	264,01	18.505	62	262,43	22.804	78	240,68
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	628	5	118,25	851	6	123,55	10.792	71	125,42
Klasse Premier EUR ausschüttend (A)	10	–	249,90	21	–	248,86	1.877	7	228,46
Klasse Premier GBP thesaurierend	1.305	10	107,52	59.027	439	101,36	5.766	44	96,06
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	13.092	90	119,06	16.174	99	123,70	11.180	65	124,19
Klasse Premier GBP ausschüttend (A)	215.539	727	243,80	402.225	1.315	230,62	436.968	1.451	218,82
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	810	27	117,40	1.154	36	121,52	605	17	120,90
Klasse LM USD thesaurierend	–	–	–	1.736	17	102,34	–	–	–
Klasse LM Euro thesaurierend	926	6	135,58	873	6	134,19	968	6	122,23
Klasse A (G) USD thesaurierend	19.351	98	197,93	22.005	108	204,09	25.296	125	202,04
Klasse B (G) USD thesaurierend	12	–	186,09	13	–	192,37	23	–	191,32
Klasse L (G) USD thesaurierend	8.493	46	186,06	9.269	48	192,34	10.358	54	191,36
Klasse GA Euro thesaurierend	121	–	292,48	138	–	291,55	310	1	269,35
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	55	–	291,37	70	–	290,53	69	–	268,47
Klasse GE USD thesaurierend	56	–	235,83	58	–	244,25	58	–	243,91
Klasse GE Euro thesaurierend	32	–	274,54	33	–	274,74	33	–	255,80
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 11.230	94	119,64	USD 10.906	96	113,27	USD 12.383	117	106,17
Klasse A USD ausschüttend (A)	247	3	98,03	346	4	94,98	620	7	91,37
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	4.814	59	80,96	8.382	107	78,65	6.543	84	77,68
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	107	1	93,55	124	1	90,36	121	1	88,30
Klasse A USD ausschüttend (Q)	1.138	12	96,83	332	4	92,68	318	4	89,14
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.743	33	79,06	3.634	66	77,21	1.991	33	76,70
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	136	12	82,70	154	13	80,55	408	32	79,53
Klasse A Euro thesaurierend	122	1	107,58	133	1	98,42	153	1	86,01
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	190	2	97,08	80	1	93,33	11	–	90,06
Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	317	4	79,74	322	4	78,23	478	5	78,73
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	2.394	229	81,84	3.537	349	79,60	2.113	211	78,52
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	123	215	0,80	517	899	0,78	133	227	0,77
Klasse B USD thesaurierend	34	–	106,19	45	–	100,80	85	1	94,97
Klasse B USD ausschüttend (A)	13	–	97,75	12	–	94,50	30	–	90,95
Klasse C USD thesaurierend	1.372	12	115,37	1.318	12	109,51	1.472	14	103,16
Klasse C USD ausschüttend (A)	257	3	97,75	245	3	94,50	316	3	90,95
Klasse C USD ausschüttend (Q)	210	2	89,87	221	3	86,03	308	4	82,74
Klasse F USD thesaurierend	19.671	176	111,52	20.510	195	105,26	24.279	248	98,07
Klasse F EUR thesaurierend	52	–	110,70	50	–	100,96	46	–	87,71
Klasse F EUR ausschüttend (A)	72	1	97,43	70	1	91,45	67	1	82,08
Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	32	–	96,83	31	–	93,24	30	–	90,54
Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	53	1	94,95	54	1	92,85	57	1	92,86
Klasse Premier USD ausschüttend (M) Plus (e)	25	–	99,35	24	–	95,49	22	–	92,41
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^									
Klasse A USD ausschüttend (A)	USD 297	2	159,73	USD 147	1	146,53	USD 138	1	135,23
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	145	1	147,07	144	1	137,01	142	1	130,35
Klasse X USD ausschüttend (A)	591	4	163,44	333	2	149,54	137	1	137,20
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	148	1	150,58	142	1	139,88	145	1	132,25
Klasse X GBP thesaurierend	1.318	6	192,31	471	2	161,29	163	1	142,43
Klasse Premier USD ausschüttend (A)	332	2	163,96	303	2	150,18	2.147	16	137,73
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	300	2	152,69	288	2	141,59	291	2	133,37
Klasse Premier GBP thesaurierend	630	3	205,36	576	3	172,00	526	3	151,48
Klasse S USD thesaurierend	9.217	80	115,45	6.589	63	105,08	–	–	–
Klasse S GBP thesaurierend	1	–	99,50	–	–	–	–	–	–
Klasse S GBP ausschüttend (Q)	1	–	99,50	–	–	–	–	–	–
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 137.006	826	165,82	USD 196.967	1.078	182,74	USD 271.012	1.458	185,94
Klasse A USD ausschüttend (A)	68.942	137	503,61	86.332	156	554,97	107.857	191	564,69
Klasse A AUD thesaurierend (abgesichert)	7.195	77	138,72	8.766	80	153,83	8.352	68	158,29
Klasse A CNH thesaurierend (mit Absicherung)	1.237	81	109,64	1.158	64	121,19	123	6	122,37
Klasse A Euro thesaurierend	10.620	49	197,58	17.211	72	210,41	21.987	90	199,63
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	5.201	36	131,96	11.639	69	147,78	39.941	211	155,48
Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)	117	1	100,85	169	1	112,93	219	2	118,66
Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)	502	4	108,59	1.365	9	120,89	1.608	9	125,73
Klasse A GBP ausschüttend (A)	701	3	215,30	721	2	217,64	897	3	213,30
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	45	3	133,60	90	6	149,66	468	25	158,01
Klasse A SGD thesaurierend	1.895	1.560	1,69	2.620	1.957	1,81	4.194	3.077	1,81
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	3.441	2.943	1,62	3.620	2.724	1,80	5.707	4.090	1,85
Klasse B USD thesaurierend	106	1	174,28	135	1	192,53	366	2	196,90
Klasse B USD ausschüttend (A)	5	–	466,29	6	–	515,21	69	–	527,05
Klasse C USD thesaurierend	2.984	17	174,58	5.332	28	192,88	6.963	35	197,24
Klasse C USD ausschüttend (A)	5.433	12	463,07	6.634	13	511,60	7.680	15	523,17
Klasse E USD thesaurierend	1.945	12	157,35	2.970	17	174,06	4.874	27	178,44
Klasse E USD ausschüttend (A)	336	2	157,32	608	3	174,03	1.189	7	178,41
Klasse E Euro thesaurierend	452	2	205,62	522	2	219,78	575	2	210,12
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	188	2	108,13	340	2	121,55	484	3	128,76
Klasse F USD thesaurierend	9.082	51	176,60	12.198	63	194,01	10.743	55	196,23
Klasse F USD ausschüttend (A)	526	3	176,78	705	4	194,22	1.053	5	196,44
Klasse R USD thesaurierend	7	–	105,17	7	–	115,61	8	–	117,04
Klasse R EUR thesaurierend	156	1	151,76	169	1	161,19	200	1	152,22
Klasse X USD thesaurierend	12.674	81	155,78	23.071	135	171,01	64.756	375	172,71
Klasse X USD ausschüttend (A)	1.813	17	108,00	2.264	19	118,57	11.311	94	119,73
Klasse X EUR thesaurierend	1.745	16	96,72	2.206	19	102,61	23.867	202	96,72
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	2.293	18	114,39	12.000	83	127,77	22.031	135	133,37
Klasse X GBP thesaurierend	25.814	102	208,01	38.280	138	209,53	77.837	277	203,94
Klasse X GBP ausschüttend (A)	1.413	6	190,54	2.139	8	191,96	511	2	186,77
Klasse Premier USD thesaurierend	114.496	564	202,96	271.040	1.219	222,41	324.121	1.448	223,83
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	2.125	96	91,72	2.546	96	99,70	2.897	96	98,08
Klasse Premier Euro thesaurierend	3.050	10	267,22	6.555	20	282,97	5.091	16	265,77
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	3.184	24	122,44	12.071	78	136,39	425	2	141,72
Klasse Premier GBP thesaurierend	83.387	350	195,68	149.111	571	196,77	134.985	514	190,80
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	957	46	82,44	1.453	60	90,94	–	–	–
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund									
Klasse A USD thesaurierend	32.096	204	157,71	39.559	235	168,55	84.646	515	164,47
Klasse A USD ausschüttend (A)	9.030	34	267,18	10.668	37	285,56	14.378	52	278,73

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2019			28. Februar 2019			28. Februar 2018		
	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 Royce US Smaller Companies Fund (Fortsetzung)									
Klasse A Euro thesaurierend	USD 1.585	6	250,86	USD 2.195	7	259,04	USD 3.784	13	235,96
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	69	1	117,46	78	1	127,45	602	4	128,59
Klasse A EUR ausschüttend (A)	29	–	177,91	31	–	183,73	30	–	167,21
Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	16	–	112,34
Klasse A GBP ausschüttend (A)	32	–	259,53	34	–	254,47	34	–	239,32
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	7	1	121,24	8	1	131,55	8	1	133,14
Klasse B USD thesaurierend	25	–	155,84	27	–	166,97	489	3	163,67
Klasse B USD ausschüttend (A)	–	–	–	16	–	265,11	53	–	260,02
Klasse C USD thesaurierend	2.880	18	155,69	3.630	22	166,82	4.124	25	163,63
Klasse C USD ausschüttend (A)	3.086	13	246,18	4.246	16	263,78	5.811	22	258,78
Klasse E USD thesaurierend	1.329	8	168,35	1.624	9	180,62	1.593	9	177,64
Klasse E USD ausschüttend (A)	112	1	168,32	136	1	180,59	239	1	177,60
Klasse E Euro thesaurierend	8	–	106,84	7	–	110,73	43	–	156,77
Klasse F USD thesaurierend	4.881	25	191,57	5.749	28	204,12	6.096	31	198,06
Klasse F USD ausschüttend (A)	86	–	205,43	92	–	218,89	6	–	212,37
Klasse R USD thesaurierend	538	5	112,76	978	8	120,21	1.154	10	116,75
Klasse X USD thesaurierend	4.660	34	137,95	5.650	38	146,88	6.038	42	142,30
Klasse X USD ausschüttend (A)	8	–	96,63	8	–	102,87	7.513	58	130,16
Klasse Premier USD thesaurierend	863	4	206,66	922	4	219,63	745	4	212,05
Klasse Premier USD ausschüttend (A)	7.472	51	145,68	12.351	79	155,51	13.809	91	150,97
Klasse Premier GBP ausschüttend (A)	2.014	9	192,12	2.509	10	188,12	2.965	12	175,97
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	813	21	130,31
Klasse LM USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	452	3	135,72
Klasse LM Euro thesaurierend	1.026	7	138,47	949	6	141,65	1.048	7	126,54
Klasse A (G) USD thesaurierend	940	5	173,37	1.041	6	184,73	1.170	7	179,24
Klasse L (G) USD thesaurierend	899	6	162,89	960	6	174,00	1.060	6	169,68
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fonds									
Klasse A USD thesaurierend	EUR 899	11	87,60	EUR 1.102	14	92,52	EUR 2.217	28	96,60
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	2.016	18	124,44	2.435	22	125,14	3.857	40	118,79
Klasse A USD ausschüttend (A)	1.329	9	168,78	1.678	10	182,78	1.874	12	195,19
Klasse A USD ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	6.421	73	96,09	7.931	90	99,88	11.840	143	101,02
Klasse A USD ausschüttend (Q) (abgesichert)	1	–	98,63	1	–	101,42	1	–	98,80
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.957	34	94,10	4.067	66	98,32	3.848	61	99,86
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	101	8	100,99	109	8	105,31	259	19	106,19
Klasse A Euro thesaurierend	470	3	173,74	461	3	177,20	6.683	39	172,50
Klasse A EUR ausschüttend (A)	587	4	156,20	2.758	17	163,47	2.679	16	162,83
Klasse A EUR ausschüttend (M) Plus	350	4	96,03	382	4	99,80	605	6	100,83
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	294	516	0,87	334	566	0,91	285	497	0,93
Klasse B USD thesaurierend	164	2	82,01	255	3	86,79	395	5	91,02
Klasse B USD ausschüttend (A)	51	–	166,41	52	–	179,74	128	1	191,93
Klasse C USD thesaurierend	820	11	83,69	940	12	88,54	1.653	22	93,01
Klasse C USD ausschüttend (A)	1.354	9	166,28	1.444	9	179,62	1.646	10	191,77
Klasse C USD ausschüttend (Q) (abgesichert)	–	–	–	19	–	101,03	17	–	98,28
Klasse E USD thesaurierend (abgesichert)	329	4	102,10	321	4	103,08	497	6	98,57
Klasse E USD ausschüttend (Q) (abgesichert)	–	–	–	1	–	100,83	1	–	98,14
Klasse F USD thesaurierend	1.539	16	106,73	1.430	14	112,34	1.632	17	116,63
Klasse F USD ausschüttend (Q) (abgesichert)	1	–	98,64	1	–	101,45	1	–	98,80
Klasse X EUR thesaurierend	–	–	–	1	–	112,36	1	–	108,48
Klasse Premier Euro thesaurierend	238	2	124,94	185	1	126,79	80	1	122,19
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	70	3	108,66	55	2	109,27	48	2	103,39
Klasse LM USD thesaurierend	2.839	28	112,52	3.986	38	117,90	502	5	121,29
Klasse LM Euro thesaurierend	2.610	22	116,84	2.310	20	118,17	2.475	22	113,17
Klasse A (G) USD thesaurierend	929	11	90,14	1.037	12	95,01	1.381	17	98,90
Klasse B (G) USD thesaurierend	1	–	84,19	2	–	88,98	1	–	93,06
Klasse L (G) USD thesaurierend	190	2	84,94	194	2	89,75	249	3	93,91
Klasse GA USD thesaurierend	990	7	154,52	1.022	7	162,92	1.020	7	169,75
Klasse GA Euro thesaurierend	17.205	97	178,00	18.525	102	181,34	19.214	109	176,15
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	113	1	148,65	119	1	155,69	118	1	155,11
Klasse GE USD thesaurierend	40	–	143,96	40	–	152,36	40	–	159,94
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 8.959	65	137,90	USD 6.194	42	145,76	USD 6.321	42	150,45
Klasse A USD ausschüttend (A)	5.604	23	239,52	6.329	24	258,91	5.821	21	271,87
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	14.472	151	95,65	15.914	154	103,25	18.969	171	111,14
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	4.801	72	98,83	7.552	99	107,46	4.818	53	116,45
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	314	26	86,58	294	21	93,78	–	–	–
Klasse A Euro thesaurierend	233	2	127,14	516	3	129,92	189	1	125,08
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	3.917	319	96,37	6.714	506	104,17	6.581	460	111,85
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	140	186	1,05	172	205	1,13	142	152	1,23
Klasse B USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	60	1	105,68
Klasse B USD ausschüttend (A)	82	–	233,72	88	–	252,04	99	–	264,69
Klasse C USD thesaurierend	202	2	96,05	214	2	101,78	780	7	105,65
Klasse C USD ausschüttend (A)	1.985	9	232,45	2.289	9	250,67	3.619	14	263,31
Klasse E USD thesaurierend	105	1	132,39	111	1	140,49	128	1	146,27
Klasse E USD ausschüttend (A)	11	–	98,58	12	–	106,14	14	–	110,86
Klasse F USD thesaurierend	84	1	121,31	73	1	127,85	902	7	131,33
Klasse F USD ausschüttend (A)	197	2	104,51	208	2	113,27	215	2	118,76
Klasse X USD ausschüttend (A)	–	–	–	1	–	126,96	1	–	132,91
Klasse X EUR thesaurierend	4.420	40	100,03	4.656	40	101,82	–	–	–
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	2.658	83	127,20	3.134	88	134,78	3.263	80	139,39
Klasse S USD thesaurierend	–	–	–	2.371	23	105,38	2.415	23	107,34
Klasse GA USD thesaurierend	7.708	56	138,62	8.636	59	146,49	9.260	61	151,26
Klasse GA Euro thesaurierend	221	1	160,44	234	1	163,82	277	1	157,69
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	22	–	144,19	31	–	150,62	32	–	147,39
Klasse LM SGD thesaurierend (abgesichert)	18.674	27.909	0,93	20.217	27.952	0,98	–	–	–
Klasse GE USD thesaurierend	463	4	129,57	491	4	137,44	511	4	142,98
Klasse GE Euro thesaurierend	14	–	150,36	15	–	154,11	16	–	149,46
Klasse S SGD thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	20.154	27.900	0,96
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund									
Klasse A USD thesaurierend	USD 2.493	14	172,04	USD 2.263	13	169,48	USD 2.331	14	168,81
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1.433	14	102,06	1.574	15	102,82	3.176	30	106,93
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	997	15	99,94	1.101	15	101,28	1.289	16	106,07
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	411	31	103,06	579	44	103,97	1.140	83	107,79
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	9	11	1,05	32	41	1,06	47	56	1,12
Klasse X USD thesaurierend	–	–	–	40	–	119,82	1.778	15	118,54
Klasse GA USD thesaurierend	3.837	22	175,41	3.797	22	172,85	4.019	23	172,34
Klasse GA Euro thesaurierend	3.108	12	228,75	3.258	13	217,80	3.409	14	202,47
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	377	2	204,99	382	2	200,23	404	2	190,16
Klasse GE USD thesaurierend	43	–	164,93	43	–	163,15	43	–	163,89
Klasse GE Euro thesaurierend	290	1	214,89	302	1	205,38	334	1	192,38
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 1	–	123,71	USD 4	–	128,67	USD 4	–	134,87
Klasse M GBP ausschüttend (A)	67.367	3.138	17,63	73.014	3.282	16,72	75.916	3.236	16,95

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2019			28. Februar 2019			28. Februar 2018		
	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 Asia Long-Term Unconstrained Fund^ (Fortsetzung)									
Klasse E USD thesaurierend	USD 1	–	120,96	USD 1	–	126,09	USD 1	–	132,90
Klasse F USD thesaurierend	1	–	126,08	1	–	130,70	1	–	136,08
Klasse M USD ausschüttend (A)	82.189	6.136	13,39	84.791	6.111	13,88	61.123	4.177	14,63
Klasse M Euro ausschüttend (A)	45.475	2.636	15,62	46.400	2.596	15,65	48.198	2.557	15,43
Klasse Premier USD thesaurierend	8.147	88	92,06	8.421	88	95,16	–	–	–
Klasse Premier GBP thesaurierend	40.636	319	104,50	42.006	319	98,88	–	–	–
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^									
Klasse A (PF) USD thesaurierend	EUR 1	–	98,80	EUR 1	–	101,53	EUR 1	–	116,16
Klasse A (PF) USD thesaurierend (abgesichert)	1	–	109,17	1	–	106,76	1	–	111,02
Klasse A (PF) USD ausschüttend (A) (abgesichert)	9.335	696	14,82	11.269	888	14,49	11.149	904	15,07
Klasse A (PF) EUR thesaurierend	5.641	55	101,84	6.879	68	101,21	2.130	20	108,67
Klasse A (PF) EUR ausschüttend (A)	11.512	872	13,20	16.113	1.230	13,10	16.453	1.173	14,03
Klasse A (PF) GBP ausschüttend (A) (abgesichert)	306	20	13,77	359	23	13,59	547	34	14,38
Klasse A (PF) NOK ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	91	8	104,90
Klasse E (PF) USD thesaurierend	1	–	96,27	1	–	99,36	1	–	114,67
Klasse E (PF) USD thesaurierend (abgesichert)	1	–	106,32	1	–	104,42	1	–	109,50
Klasse F (PF) USD thesaurierend	1	–	100,09	1	–	102,62	1	–	116,92
Klasse F (PF) USD thesaurierend (abgesichert)	1	–	110,47	1	–	107,82	1	–	111,66
Klasse J (PF) USD thesaurierend (abgesichert)	1.835	20	101,33	1.732	20	98,86	–	–	–
Klasse J (PF) JPY thesaurierend (abgesichert)	57.580	714	9.473,29	59.723	808	9.345,95	–	–	–
Klasse M (PF) USD ausschüttend (A) (abgesichert)	3.335	248	14,86	4.730	372	14,50	7.563	616	15,00
Klasse M (PF) Euro thesaurierend	46.189	449	102,98	63.519	622	102,08	39.911	366	109,00
Klasse M (PF) Euro ausschüttend (A)	72.114	5.264	13,70	87.235	6.428	13,57	102.040	7.066	14,44
Klasse M (PF) GBP ausschüttend (A) (abgesichert)	4.783	304	14,25	8.582	525	14,03	10.326	617	14,77
Klasse M (PF) NOK ausschüttend (A) (abgesichert)	24	2	103,28	98	9	101,46	47	4	106,82
Klasse M (PF) SEK ausschüttend (A) (abgesichert)	2.469	262	102,02	2.989	310	101,02	4.159	390	107,64
Klasse Premier (PF) USD thesaurierend (abgesichert)	12.517	127	108,86	9.495	102	106,12	10.783	120	109,52
Klasse Premier (PF) BRL thesaurierend (abgesichert)	2.147	96	103,06	2.247	96	99,84	–	–	–
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^									
Klasse A USD ausschüttend (A)	USD 15.500	496	31,28	USD 15.297	503	30,42	USD 17.774	515	34,54
Klasse A EUR ausschüttend (A)	209	20	9,53	201	20	8,96	227	20	9,51
Klasse X USD ausschüttend (A)	352	2	158,72	341	2	153,82	2	–	174,66
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 6	–	149,43	USD 6	–	140,20	USD 5	–	133,13
Klasse A Euro thesaurierend	21	–	149,28	9	–	135,46	8	–	120,19
Klasse E USD thesaurierend	1	–	101,45	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR thesaurierend	11	–	153,05	10	–	138,35	10	–	121,84
Klasse X GBP thesaurierend	774	4	165,49	478	3	141,67	379	2	128,33
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)	149	1	145,14	86	–	137,09	41	–	131,82
Klasse Premier USD thesaurierend	688	4	154,52	7	–	144,17	7	–	135,40
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	231	2	99,72	–	–	–	–	–	–
Klasse S GBP thesaurierend	24.303	117	170,99	22.634	117	145,78	21.350	118	131,12
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 1.219	14	88,00	USD 1.077	12	90,45	USD 899	9	101,16
Klasse E USD thesaurierend	1	–	100,28	1	–	103,45	–	–	–
Klasse F USD thesaurierend	1	–	109,09	1	–	111,74	–	–	–
Klasse X USD thesaurierend	522	6	93,00	534	6	95,22	593	6	105,70
Klasse Premier USD thesaurierend	2.239	24	93,56	895	9	95,63	594	6	105,79
Klasse S USD thesaurierend	1.546	14	112,93	2.079	18	115,31	–	–	–
Klasse S Euro thesaurierend	21.159	200	95,82	21.606	200	94,62	13.138	110	97,76
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^									
Klasse A Euro thesaurierend	EUR 506	4	114,80	EUR 465	4	106,43	EUR –	–	–
Klasse X EUR thesaurierend	524	5	115,50	467	4	106,67	–	–	–
Klasse Premier Euro thesaurierend	2.027	17	115,83	1.868	17	106,78	–	–	–
Klasse S Euro thesaurierend	2.748	28	99,94	–	–	–	–	–	–
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	EUR 1	–	10,42	EUR 1	–	10,12	EUR 1	–	9,49
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	15.887	1.478	11,81	5.524	575	10,93	5.607	733	9,34
Klasse A USD ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	13.089	1.481	9,71	3.299	405	9,26	102	15	8,37
Klasse A USD ausschüttend (Q)	2.119	198	11,77	1.638	162	11,52	2.329	258	11,00
Klasse A Euro thesaurierend	67.195	5.712	11,76	78.665	7.128	11,04	1.370	142	9,66
Klasse A EUR ausschüttend (M) Plus	626	56	11,23	3	–	10,69	–	–	–
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	267	424	0,96	249	416	0,92	324	626	0,84
Klasse C USD thesaurierend	251	27	10,13	236	27	9,86	78	10	9,29
Klasse C USD thesaurierend (abgesichert)	271	26	11,36	243	26	10,54	59	8	9,05
Klasse E USD thesaurierend	519	48	11,91	896	88	11,61	1.071	119	10,98
Klasse F USD thesaurierend	1.040	110	10,41	1.166	132	10,08	671	87	9,42
Klasse F USD thesaurierend (abgesichert)	740	70	11,61	17	2	10,70	1	–	9,10
Klasse X USD thesaurierend	413	45	–	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD ausschüttend (A)	362	38	10,54	324	36	10,19	303	38	9,72
Klasse X EUR thesaurierend	1.329	114	11,63	13	1	10,87	–	–	–
Klasse X GBP ausschüttend (Q)	45	4	–	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD thesaurierend	3.139	264	13,06	2.504	226	12,60	412	43	11,72
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	2.919	992	13,40	2.651	932	12,15	2.360	932	10,03
Klasse Premier CAD ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	57.488	8.422	9,99	61.661	9.630	9,58	61.598	10.790	8,94
Klasse Premier CAD ausschüttend (Q) Plus (e)	31.734	4.711	9,86	30.357	4.729	9,61	26.344	4.571	9,02
Klasse Premier Euro thesaurierend	158.629	8.505	18,65	117.196	6.735	17,40	66.305	4.398	15,08
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert) (PH)	15.509	1.500	10,34	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP thesaurierend	2.052	137	13,54	2.318	166	12,00	723	60	10,75
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	5.989	470	11,51	5.859	470	10,69	4.872	470	9,19
Klasse Premier GBP ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	79.719	3.839	18,76	78.247	3.804	17,64	123.347	6.608	16,54
Klasse Premier GBP ausschüttend (Q)	29.947	2.239	12,08	5.697	449	10,89	–	–	–
Klasse LM USD thesaurierend (abgesichert)	3.882	424	10,07	–	–	–	–	–	–
Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	USD 200	2	91,97	USD 199	2	91,20	USD 221	2	101,39
Klasse A USD ausschüttend (Q)	184	2	90,09	182	2	89,91	203	2	100,90
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	716	7	87,48	745	7	87,87	910	7	100,11
Klasse X GBP ausschüttend (Q)	751	7	93,09	745	7	85,23	821	6	91,99
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	900	9	87,91	934	9	88,21	1.139	9	100,29

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

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

µ Zum 2. August 2019 hat den Handel eingestellt.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

Gesamtergebnisrechnung

(in Tsd.)	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	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
ERTRÄGE AUS ANLAGEN:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	USD 3.108	USD 2.179	USD 22.533	USD 17.282	EUR 855	EUR 736	USD 664	USD 858
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten:								
Realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	2.713	116	18.513	(8.539)	1.115	(539)	(170)	(161)
Nicht realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	8.611	221	56.531	(15.743)	7.968	(1.038)	56	(95)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	14.432	2.516	97.577	(7.000)	9.938	(841)	550	602
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	804	698	3.373	2.772	19	19	143	184
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	54	41	352	258	37	32	8	8
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	117	100	218	190	2	2	12	16
Anwaltsgebühren	1	1	5	4	–	1	–	–
Wirtschaftsprüfungsgebühren	14	15	21	22	13	12	14	15
Druckgebühren	10	2	67	16	8	2	2	1
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	2	1	1	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	1	–	5	3	1	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	21	38	79	127	13	29	14	25
Aufwendungen insgesamt	1.022	895	4.122	3.393	94	97	193	249
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Zurückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	(3)	–	(6)	–	–	(15)	(19)
Nettoaufwendungen insgesamt	1.022	892	4.122	3.387	94	97	178	230
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**13.410**	**1.624**	**93.455**	**(10.387)**	**9.844**	**(938)**	**372**	**372**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(1.729)	(1.025)	(760)	(566)	(3)	(1)	(338)	(440)
Gewinn/(Verlust) für den Berichtszeitraum	**11.681**	**599**	**92.695**	**(10.953)**	**9.841**	**(939)**	**34**	**(68)**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(1)	(7)	(96)	(97)	(6)	–	–	2
Nettozunahme/(-abnahme) des den Inhabern rückgabe- und gewinnberechtigter Anteile Rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile aus dem operativen Geschäft	**USD 11.680**	**USD 592**	**USD 92.599**	**USD (11.050)**	**EUR 9.835**	**EUR (939)**	**USD 34**	**USD (66)**

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund		Legg Mason Western Asset Global Credit Absolute Return Fund^		Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
ERTRÄGE AUS ANLAGEN:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	USD 3.967	USD 6.136	USD 671	USD 801	USD –	USD –	USD 1.578	USD 754
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	(3)	(2)	1	–	–	3	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten:								
Realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(985)	(2.279)	(621)	284	–	–	(10.908)	(2.711)
Nicht realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(482)	(6.490)	1.135	(1.241)	–	–	2.251	(1.424)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	2.500	(2.636)	1.183	(155)	–	–	(7.076)	(3.381)
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	709	932	52	73	–	–	214	117
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	38	54	13	11	–	–	47	18
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	72	86	8	11	–	–	3	5
Anwaltsgebühren	1	1	–	–	–	–	1	–
Wirtschaftsprüfungsgebühren	21	22	14	15	–	–	14	15
Druckgebühren	10	4	3	1	–	–	6	1
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	1	1	–	–	–	–	1	–
Sonstige Aufwendungen	24	58	9	25	–	–	25	33
Aufwendungen insgesamt	876	1.158	99	136	–	–	311	189
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Zurückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(3)	(3)	(4)	(9)	–	–	(5)	(16)
Nettoaufwendungen insgesamt	873	1.155	95	127	–	–	306	173
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**1.627**	**(3.791)**	**1.088**	**(282)**	**–**	**–**	**(7.382)**	**(3.554)**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(2.006)	(3.266)	(53)	(61)	–	–	(1.461)	(654)
Gewinn/(Verlust) für den Berichtszeitraum	**(379)**	**(7.057)**	**1.035**	**(343)**	**–**	**–**	**(8.843)**	**(4.208)**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(17)	(16)	–	2	–	–	(13)	(3)
Nettozunahme/(-abnahme) des den Inhabern rückgabe- und gewinnberechtigter Anteile Rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile aus dem operativen Geschäft	**USD (396)**	**USD (7.073)**	**USD 1.035**	**USD (341)**	**USD –**	**USD –**	**USD (8.856)**	**USD (4.211)**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

	Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		Legg Mason Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
	USD 20.126	USD 26.472	USD 4.985	USD 8.384	USD 742	USD 945	USD 1.036	USD 1.071
	1	–	–	–	–	–	–	–
	(3)	(106)	(3)	(1)	–	–	(2)	(1)
	(34.550)	(53.924)	(1.796)	(1.572)	(663)	(468)	(120)	(382)
	4.174	(51.764)	4.219	(69)	571	(2.156)	1.826	(2.004)
	(10.252)	(79.322)	7.405	6.742	650	(1.679)	2.740	(1.316)
	1.318	1.847	579	896	176	219	–	–
	–	–	–	–	–	–	–	–
	214	258	49	71	8	8	14	11
	94	112	62	78	11	15	–	–
	3	5	–	1	–	–	–	–
	23	22	21	22	14	15	11	11
	57	20	14	6	2	–	3	1
	–	–	–	–	–	–	–	–
	2	2	–	–	–	–	–	–
	4	4	1	1	–	–	–	–
	49	153	23	63	12	21	8	20
	1.764	2.423	749	1.138	223	278	36	43
	(1)	(10)	–	(7)	(11)	(14)	–	–
	1.763	2.413	749	1.131	212	264	36	43
	(12.015)	**(81.735)**	**6.656**	**5.611**	**438**	**(1.943)**	**2.704**	**(1.359)**
	(5.976)	(6.993)	(2.249)	(3.279)	(308)	(417)	(969)	(1.005)
	(17.991)	**(88.728)**	**4.407**	**2.332**	**130**	**(2.360)**	**1.735**	**(2.364)**
	(219)	(342)	(5)	(27)	(5)	(11)	–	(8)
	USD (18.210)	**USD (89.070)**	**USD 4.402**	**USD 2.305**	**USD 125**	**USD (2.371)**	**USD 1.735**	**USD (2.372)**

	Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
	USD 3.858	USD 3.128	USD 1.208	USD 1.151
	–	–	–	–
	–	–	–	–
	(1.423)	(837)	1.153	2.664
	12.014	(9.117)	4.266	(3.338)
	14.449	(6.826)	6.627	477
	339	407	16	17
	–	–	–	–
	79	54	24	19
	4	2	2	3
	1	1	–	–
	15	15	15	15
	16	4	5	1
	–	–	–	–
	–	–	–	–
	1	1	–	–
	29	42	13	25
	484	526	75	80
	–	(8)	–	(1)
	484	518	75	79
	13.965	**(7.344)**	**6.552**	**398**
	(21)	(23)	(9)	(22)
	13.944	**(7.367)**	**6.543**	**376**
	(67)	(45)	(9)	(14)
	USD 13.877	**USD (7.412)**	**USD 6.534**	**USD 362**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^		Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
ERTRÄGE AUS ANLAGEN:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	EUR 1.596	EUR 1.750	USD 203.848	USD 209.450	USD 1.604	USD 4.883	USD 22.084	USD 14.799
Zinsen	–	–	11	13	–	1	–	–
Ausgleich	–	–	(384)	(431)	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten:								
Realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	685	499	689.450	(415.612)	(1.233)	(13.622)	(42.746)	(44.564)
Nicht realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	618	(1.462)	(903.103)	(707.777)	(596)	(14.432)	(10.321)	(15.374)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	2.899	787	(10.178)	(914.357)	(225)	(23.170)	(30.983)	(45.139)
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	2	2	41.894	54.497	87	318	22	22
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	24	22	2.121	2.466	13	36	225	142
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	2.858	3.662	–	–	–	5
Anwaltsgebühren	–	–	32	45	–	1	4	2
Wirtschaftsprüfungsgebühren	13	12	21	22	17	15	15	22
Druckgebühren	5	2	533	176	6	3	43	7
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	6	–	14	48	–	–	–	1
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	34	36	–	1	3	2
Sonstige Aufwendungen	11	23	264	877	12	38	57	62
Aufwendungen insgesamt	61	61	47.771	61.829	135	412	369	265
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Zurückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	(7)	–	(1)	(21)	(21)	–	(2)
Nettoaufwendungen insgesamt	61	54	47.771	61.828	114	391	369	263
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**2.838**	**733**	**(57.949)**	**(976.185)**	**(339)**	**(23.561)**	**(31.352)**	**(45.402)**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(246)	(236)	(40.163)	(32.677)	(71)	(71)	(2)	(165)
Gewinn/(Verlust) für den Berichtszeitraum	**2.592**	**497**	**(98.112)**	**(1.008.862)**	**(410)**	**(23.632)**	**(31.354)**	**(45.567)**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(3)	–	(7.857)	(5.125)	(60)	(84)	(235)	(182)
Nettozunahme/(-abnahme) des den Inhabern rückgabe- und gewinnberechtigter Anteile Rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile aus dem operativen Geschäft	**EUR 2.589**	**EUR 497**	**USD (105.969)**	**USD (1.013.987)**	**USD (470)**	**USD (23.716)**	**USD (31.589)**	**USD (45.749)**

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^		Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
ERTRÄGE AUS ANLAGEN:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	USD 21.389	USD 23.984	USD 23.516	USD 29.347	USD 2.288	USD 2.541	USD 13.828	USD 14.325
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	19	43	(104)	(40)	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten:								
Realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(39.154)	(55.210)	(103.873)	(52.738)	(246)	(2.024)	(17.234)	(24.643)
Nicht realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	20.708	(77.146)	19.767	(113.869)	404	(660)	6.870	(52.344)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	2.962	(108.329)	(60.694)	(137.300)	2.446	(143)	3.464	(62.662)
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	3.339	4.397	3.136	4.140	55	54	1.461	1.578
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	311	353	316	382	29	27	191	193
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	399	525	32	45	3	3	38	36
Anwaltsgebühren	5	7	5	7	–	1	3	3
Wirtschaftsprüfungsgebühren	23	22	16	15	14	15	14	15
Druckgebühren	79	25	87	26	7	2	45	13
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	8	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	5	5	5	5	1	–	3	3
Sonstige Aufwendungen	82	211	60	165	11	26	46	103
Aufwendungen insgesamt	4.243	5.545	3.657	4.793	120	128	1.801	1.944
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Zurückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	(2)	(1)	(1)	(3)	(1)	–	(3)
Nettoaufwendungen insgesamt	4.243	5.543	3.656	4.792	117	127	1.801	1.941
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**(1.281)**	**(113.872)**	**(64.350)**	**(142.092)**	**2.329**	**(270)**	**1.663**	**(64.603)**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(3.117)	(2.778)	(3.582)	(3.219)	(9)	(6)	(422)	(241)
Gewinn/(Verlust) für den Berichtszeitraum	**(4.398)**	**(116.650)**	**(67.932)**	**(145.311)**	**2.320**	**(276)**	**1.241**	**(64.844)**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(374)	(415)	(770)	(1.113)	(13)	3	(491)	(538)
Nettozunahme/(-abnahme) des den Inhabern rückgabe- und gewinnberechtigter Anteile Rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile aus dem operativen Geschäft	**USD (4.772)**	**USD (117.065)**	**USD (68.702)**	**USD (146.424)**	**USD 2.307**	**USD (273)**	**USD 750**	**USD (65.382)**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

	Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^		Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
	USD 833	USD 1.512	USD 41.794	USD 39.527	USD 15.513	USD 14.599	USD 2.608	USD 2.571
	–	–	–	–	–	–	–	–
	–	–	5	(22)	–	–	–	–
	(923)	(2.394)	(16.547)	(14.899)	(2.240)	(3.418)	(5.628)	(9.309)
	2.761	(5.589)	34.994	7.323	32.598	1.021	4.046	(898)
	2.671	(6.471)	60.246	31.929	45.871	12.202	1.026	(7.636)
	157	174	2.436	2.519	1	–	28	17
	–	–	–	–	–	–	–	–
	18	25	386	374	283	275	36	33
	–	–	31	17	–	–	4	3
	–	–	6	6	4	5	1	1
	15	15	14	15	14	15	14	15
	5	2	79	21	63	18	9	2
	–	–	–	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–	–	–	–
	–	–	5	4	4	4	1	–
	8	29	76	128	44	99	10	24
	203	245	3.033	3.084	413	416	103	95
	(7)	(13)	(18)	(4)	–	–	–	–
	196	232	3.015	3.080	413	416	103	95
	2.475	**(6.703)**	**57.231**	**28.849**	**45.458**	**11.786**	**923**	**(7.731)**
	(529)	(574)	(2.525)	(1.466)	(2)	–	–	–
	1.946	**(7.277)**	**54.706**	**27.383**	**45.456**	**11.786**	**923**	**(7.731)**
	(11)	(19)	–	–	–	–	3	(4)
	USD 1.935	**USD (7.296)**	**USD 54.706**	**USD 27.383**	**USD 45.456**	**USD 11.786**	**USD 926**	**USD (7.735)**

	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 das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
	USD 43.236	USD 63.844	USD 1.554	USD 2.882	USD 916	USD 1.337	USD 263	USD 572
	1	–	–	–	–	–	–	–
	–	(11.631)	(5)	10	–	–	–	–
	(58.817)	(173.692)	2.990	(11.967)	546	111	(254)	(2.062)
	5.973	(153.981)	829	279	507	(1.012)	124	434
	(9.607)	(275.460)	5.368	(8.796)	1.969	436	133	(1.056)
	1.409	1.929	441	604	182	268	21	47
	–	–	–	–	–	–	–	–
	548	823	32	41	15	18	5	7
	–	–	51	66	1	1	–	–
	9	15	–	1	–	–	–	–
	16	15	14	15	14	15	14	15
	175	59	8	3	4	1	1	1
	–	–	–	–	–	–	–	–
	1	–	–	–	–	–	–	–
	10	12	1	–	–	–	–	–
	34	251	27	43	17	30	11	22
	2.202	3.104	574	773	233	333	52	92
	–	(6)	(8)	(9)	(17)	(16)	(23)	(27)
	2.202	3.098	566	764	216	317	29	65
	(11.809)	**(278.558)**	**4.802**	**(9.560)**	**1.753**	**119**	**104**	**(1.121)**
	(18.260)	(30.430)	(1.341)	(2.530)	–	–	(611)	(1.175)
	(30.069)	**(308.988)**	**3.461**	**(12.090)**	**1.753**	**119**	**(507)**	**(2.296)**
	(2.056)	(2.097)	1	(2)	(29)	(4)	–	–
	USD (32.125)	**USD (311.085)**	**USD 3.462**	**USD (12.092)**	**USD 1.724**	**USD 115**	**USD 507**	**USD (2.296)**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^		Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^		Legg Mason ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
ERTRÄGE AUS ANLAGEN:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	USD 12.847	USD 46	USD 45	USD 52	USD 3.668	USD 3.042	USD 618	USD 836
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten:								
Realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(36.481)	130	181	(77)	(326)	4.838	(2.675)	(107)
Nicht realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(34.568)	(200)	(299)	93	4.328	12.849	371	(3.551)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	(58.202)	(24)	(73)	68	7.670	20.729	(1.686)	(2.822)
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	20	14	8	9	1.402	1.485	50	101
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	115	–	3	1	114	104	10	12
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	1	–	–	97	117	2	4
Anwaltsgebühren	2	–	–	–	2	2	–	–
Wirtschaftsprüfungsgebühren	12	2	15	15	14	15	11	11
Druckgebühren	20	–	–	–	24	7	3	1
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	2	–	–	–	2	1	–	–
Sonstige Aufwendungen	22	3	6	12	27	66	15	29
Aufwendungen insgesamt	193	20	32	37	1.682	1.797	91	158
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Zurückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	(3)	(21)	(24)	–	–	(10)	(9)
Nettoaufwendungen insgesamt	193	17	11	13	1.682	1.797	81	149
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**(58.395)**	**(41)**	**(84)**	**55**	**5.988**	**18.932**	**(1.767)**	**(2.971)**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(1)	–	–	–	(5)	(3)	(4)	(2)
Gewinn/(Verlust) für den Berichtszeitraum	**(58.396)**	**(41)**	**(84)**	**55**	**5.983**	**18.929**	**(1.771)**	**(2.973)**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(502)	(24)	(13)	(15)	(861)	(598)	(71)	(86)
Nettozunahme/(-abnahme) des den Inhabern rückgabe- und gewinnberechtigter Anteile Rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile aus dem operativen Geschäft	**USD (58.898)**	**USD (65)**	**USD (97)**	**USD 40**	**USD 5.122**	**USD 18.331**	**USD (1.842)**	**USD (3.059)**

(in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
ERTRÄGE AUS ANLAGEN:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	USD 1.062	USD 1.458	USD 76	USD 38	USD 2.551	USD 5.006	USD 655	USD 1.123
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	(2)	–	–	–	–	(5)	(1)
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten:								
Realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	1.261	(1.139)	149	20	(29.422)	57.294	3	13.850
Nicht realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	783	3.621	718	593	(36.642)	80.097	(5.002)	3.715
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	3.106	3.938	943	651	(63.513)	142.397	(4.349)	18.687
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	278	286	11	12	3.707	6.801	581	1.068
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	17	14	5	2	218	364	29	44
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	47	46	3	1	605	1.212	111	222
Anwaltsgebühren	–	–	–	–	4	6	–	1
Wirtschaftsprüfungsgebühren	15	15	7	7	21	22	14	15
Druckgebühren	3	1	1	–	75	24	9	3
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	–	–	4	5	1	1
Sonstige Aufwendungen	14	31	8	13	44	189	13	45
Aufwendungen insgesamt	374	393	35	35	4.678	8.623	758	1.399
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Zurückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(14)	(25)	(13)	(18)	(2)	(3)	(2)	(4)
Nettoaufwendungen insgesamt	360	368	22	17	4.676	8.620	756	1.395
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**2.746**	**3.570**	**921**	**634**	**(68.189)**	**133.777**	**(5.105)**	**17.292**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(327)	(330)	(1)	(8)	–	–	(64)	(108)
Gewinn/(Verlust) für den Berichtszeitraum	**2.419**	**3.240**	**920**	**626**	**(68.189)**	**133.777**	**(5.169)**	**17.184**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(150)	(246)	(21)	(10)	(626)	(1.074)	(101)	(61)
Nettozunahme/(-abnahme) des den Inhabern rückgabe- und gewinnberechtigter Anteile Rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile aus dem operativen Geschäft	**USD 2.269**	**USD 2.994**	**USD 899**	**USD 616**	**USD (68.815)**	**USD 132.703**	**USD (5.270)**	**USD 17.123**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund		Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
USD 2.040	USD 2.509	USD 7.473	USD 6.577	USD 9.245	USD 10.775
–	–	–	–	–	–
(1)	(2)	–	–	(195)	(27)
10.882	34.738	89.555	13.197	(48.644)	17.854
4.640	(18.997)	4.133	123.284	10.101	131.271
17.561	18.248	101.161	143.058	(29.493)	159.873
1.253	1.522	6.056	5.589	5.815	8.165
–	–	–	–	–	–
67	70	467	355	431	522
221	288	940	990	754	1.267
1	1	7	6	7	9
14	15	21	22	21	22
15	5	93	21	115	36
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	3	–
1	1	7	5	7	8
19	54	108	169	89	264
1.591	1.956	7.699	7.157	7.242	10.293
–	(3)	(4)	(5)	–	(3)
1.591	1.953	7.695	7.152	7.242	10.290
15.970	**16.295**	**93.466**	**135.906**	**(36.735)**	**149.583**
(67)	(72)	–	–	(1.197)	(546)
15.903	**16.223**	**93.466**	**135.906**	**(37.932)**	**149.037**
(580)	(736)	(1.639)	(1.804)	(1.660)	(1.748)
USD 15.323	**USD 15.487**	**USD 91.827**	**USD 134.102**	**USD (39.592)**	**USD 147.289**

Legg Mason PCM US Equity Fund^		Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fonds		Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
USD –	USD –	EUR 2.025	EUR 2.382	USD 2.690	USD 2.747
–	–	–	–	–	30
–	–	(49)	(5)	7	(5)
–	–	(1.870)	1.689	(1.008)	(954)
–	–	16	(490)	(6.299)	(5.091)
–	–	122	3.576	(4.610)	(3.273)
–	–	308	435	426	504
–	–	–	–	–	–
–	–	18	19	28	26
–	–	37	66	90	97
–	–	–	–	–	–
–	–	19	19	17	15
–	–	4	1	6	2
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–
–	–	10	27	29	44
–	–	396	567	596	688
–	–	(6)	(7)	(17)	(16)
–	–	390	560	579	672
–	**–**	**(268)**	**3.016**	**(5.189)**	**(3.945)**
–	–	(498)	(626)	(791)	(902)
–	**–**	**(766)**	**2.390**	**(5.980)**	**(4.847)**
–	–	(165)	(176)	(270)	(275)
USD –	**USD –**	**EUR (931)**	**EUR 2.214**	**USD (6.250)**	**USD (5.122)**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Congruix Japan Equity Fund^		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
ERTRÄGE AUS ANLAGEN:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	USD 487	USD 611	JPY –	JPY –	USD 4.872	USD 4.147	EUR 1.887	EUR 2.389
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	234
Ausgleich	–	–	–	–	(101)	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten:								
Realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	217	666	–	–	(2.787)	3.258	7.809	13.441
Nicht realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(353)	(902)	–	–	(9.000)	(12.699)	4.425	1.623
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	351	375	–	–	(7.016)	(5.294)	14.121	17.687
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	97	114	–	–	1.204	1.051	1.746	2.113
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	22	1.811
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	6	5	–	–	83	62	79	80
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	10	16	–	–	363	332	292	407
Anwaltsgebühren	–	–	–	–	1	1	1	1
Wirtschaftsprüfungsgebühren	14	15	–	–	9	7	12	12
Druckgebühren	1	–	–	–	17	4	19	5
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	3.824	3.359
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	568	840
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	–	–	1	1	1	1
Sonstige Aufwendungen	12	16	–	–	30	41	23	39
Aufwendungen insgesamt	140	166	–	–	1.708	1.499	6.587	8.668
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Zurückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(10)	(12)	–	–	(273)	(244)	(95)	(130)
Nettoaufwendungen insgesamt	130	154	–	–	1.435	1.255	6.492	8.538
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**221**	**221**	**–**	**–**	**(8.451)**	**(6.549)**	**7.629**	**9.149**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(85)	(106)	–	–	–	–	–	–
Gewinn/(Verlust) für den Berichtszeitraum	**136**	**115**	**–**	**–**	**(8.451)**	**(6.549)**	**7.629**	**9.149**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(66)	(75)	–	–	(233)	(200)	(259)	(508)
Nettozunahme/(-abnahme) des den Inhabern rückgabe- und gewinnberechtigter Anteile Rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile aus dem operativen Geschäft	**USD 70**	**USD 40**	**JPY –**	**JPY –**	**USD (8.684)**	**USD (6.749)**	**EUR 7.370**	**EUR 8.641**

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
ERTRÄGE AUS ANLAGEN:						
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	USD 248	USD 312	USD 215	USD 273	USD 443	USD 381
Zinsen	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	(1)	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten:						
Realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	243	819	296	568	(326)	(221)
Nicht realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	138	(3.179)	1.277	653	(520)	(2.650)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	628	(2.048)	1.788	1.494	(403)	(2.490)
AUFWENDUNGEN:						
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	121	134	55	47	81	73
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	7	5	10	6	10	7
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	28	31	1	1	3	3
Anwaltsgebühren	–	–	–	–	–	–
Wirtschaftsprüfungsgebühren	11	11	7	7	7	7
Druckgebühren	1	1	2	1	2	–
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	10	17	9	27	25	19
Aufwendungen insgesamt	178	199	84	89	128	109
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Zurückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(21)	(25)	(9)	(25)	(24)	(15)
Nettoaufwendungen insgesamt	157	174	75	64	104	94
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**471**	**(2.222)**	**1.713**	**1.430**	**(507)**	**(2.584)**
FINANZIERUNGSKOSTEN:						
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–
Gewinn/(Verlust) für den Berichtszeitraum	**471**	**(2.222)**	**1.713**	**1.430**	**(507)**	**(2.584)**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(26)	(30)	(24)	(36)	(45)	(44)
Nettozunahme/(-abnahme) des den Inhabern rückgabe- und gewinnberechtigter Anteile Rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile aus dem operativen Geschäft	**USD 445**	**USD (2.252)**	**USD 1.689**	**USD 1.394**	**USD 552)**	**USD (2.628)**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^				Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^			
für das sechs Monate bis 31. August 2019		für das sechs Monate bis 31. August 2018		für das sechs Monate bis 31. August 2019		für das sechs Monate bis 31. August 2018	
EUR	39	EUR	–	EUR	10.129	EUR	7.588
	–		–		–		–
	–		–		(6)		–
	21		–		3.126		(9.398)
	197		–		16.528		28.940
	257		–		29.777		27.130
	17		–		2.007		1.325
	–		–		–		–
	2		–		142		85
	2		–		152		20
	–		–		2		2
	6		–		10		9
	–		–		25		6
	–		–		–		–
	–		–		18		3
	–		–		2		1
	18		–		50		53
	45		–		2.408		1.504
	(23)		–		(12)		(7)
	22		–		2.396		1.497
	235		**–**		**27.381**		**25.633**
	–		–		(2.592)		(2.220)
	235		**–**		**24.789**		**23.413**
	(4)		–		(880)		(854)
EUR	**231**	**EUR**	**–**	**EUR**	**23.909**	**EUR**	**22.559**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^ für das sechs Monate bis 31. August 2019	Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^ für das sechs Monate bis 31. August 2018	Legg Mason Global Funds Plc für das sechs Monate bis 31. August 2019	Legg Mason Global Funds Plc für das sechs Monate bis 31. August 2018
ERTRÄGE AUS ANLAGEN:				
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	USD 53	USD 52	USD 553.668	USD 578.721
Zinsen	–	–	14	328
Ausgleich	–	–	(783)	(12.169)
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten				
Realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(39)	(170)	354.884	(758.702)
Nicht realisierte Nettogewinne (-verluste) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(40)	(393)	(692.366)	(917.087)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	(26)	(511)	215.417	(1.108.909)
AUFWENDUNGEN:				
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	16	17	93.248	116.252
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	25	2.152
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	2	1	7.743	8.241
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	2	2	8.040	10.519
Anwaltsgebühren	–	–	120	146
Wirtschaftsprüfungsgebühren	13	11	912	913
Druckgebühren	–	–	1.910	576
Dividendenaufwand	–	–	4.442	4.163
Zinsaufwendungen	–	–	698	1.145
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	124	113
Sonstige Aufwendungen	12	19	1.950	4.501
Aufwendungen insgesamt	45	50	119.212	148.721
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Zurückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(25)	(29)	(966)	(1.105)
Nettoaufwendungen insgesamt	20	21	118.246	147.616
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**(46)**	**(532)**	**97.171**	**(1.256.525)**
FINANZIERUNGSKOSTEN:				
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(9)	(8)	(104.887)	(109.006)
Gewinn/(Verlust) für den Berichtszeitraum	**(55)**	**(540)**	**(7.716)**	**(1.365.531)**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(5)	(4)	(21.389)	(20.015)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**USD (60)**	**USD (544)**	**USD (29.105)**	**USD (1.385.546)**

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

Gewinne und Verluste ergaben sich ausschließlich aus dem laufenden Geschäft, mit Ausnahme des Legg Mason Currie Japan Absolute Alpha Fund^, die den Betrieb eingestellt haben. Es gab keine sonstigen Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die Euro-Beträge für den Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, 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 RARE Infrastructure Value Fund^ wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2019 zum USD/EUR-Wechselkurs von 0,8912 umgerechnet (31. August 2018: 0,8413).

Die Yen-Beträge für den wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2019 zum USD/JPY-Wechselkurs von 109,1769 in US-Dollar umgerechnet (31. August 2018: 109,2801).

Die britischen Pfund-Beträge für den wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2019 zum USD/GBP-Wechselkurs von 0,7870 in US-Dollar umgerechnet (31. August 2018: 0,7425).

μ *Zum 2. August 2019 hat den Handel eingestellt.*

α *Zum 22. Juli 2019 hat Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^ den Handel eingestellt.*

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens

(in Tsd.)	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	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**USD 11.680**	**USD 592**	**USD 92.599**	**USD (11.050)**	**EUR 9.835**	**EUR (939)**	**USD 34**	**USD (66)**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	35.861	95.226	513.072	402.201	853	139	1.727	1.270
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	367	307	512	291	2	–	279	304
Kosten zurückgekaufter Anteile	(12.558)	(28.156)	(183.863)	(158.702)	(1.191)	(713)	(4.014)	(8.400)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**23.670**	**67.377**	**329.721**	**243.790**	**(336)**	**(574)**	**(2.008)**	**(6.826)**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	35.350	67.969	422.320	232.740	9.499	(1.513)	(1.974)	(6.892)
NETTOVERMÖGEN, DAS INHABERN RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNEN IST								
Beginn des Zeitraums	154.486	97.187	927.310	750.864	114.498	113.969	23.160	31.997
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Zeitraums	**USD 189.836**	**USD 165.156**	**USD 1.349.630**	**USD 983.604**	**EUR 123.997**	**EUR 112.456**	**USD 21.186**	**USD 25.105**

(in Tsd.)	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	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**USD (396)**	**USD (7.073)**	**USD 1.035**	**USD (341)**	**USD 15.274**	**USD (38.175)**	**USD (8.856)**	**USD (4.211)**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	27.981	45.990	680	3.391	116.884	101.229	120.176	64.936
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	332	296	12	7	164	193	2	2
Kosten zurückgekaufter Anteile	(47.438)	(86.483)	(3.834)	(1.207)	(122.395)	(166.293)	(6.982)	(10.803)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**(19.125)**	**(40.197)**	**(3.142)**	**2.191**	**(5.347)**	**(64.871)**	**113.196**	**54.135**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(19.521)	(47.270)	(2.107)	1.850	9.927	(103.046)	104.340	49.924
NETTOVERMÖGEN, DAS INHABERN RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNEN IST								
Beginn des Zeitraums	120.810	219.969	38.010	38.779	501.640	564.501	100.381	34.777
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Zeitraums	**USD 101.289**	**USD 172.699**	**USD 35.903**	**USD 40.629**	**USD511.567**	**USD461.455**	**USD 204.721**	**USD 84.701**

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^		Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**EUR 2.589**	**EUR 497**	**USD (105.969)**	**USD (1.013.987)**	**USD (470)**	**USD (23.716)**	**USD (31.589)**	**USD (45.749)**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	773	18	1.076.921	1.443.676	–	5.014	43.347	129.419
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	241	230	1.361	877	69	69	–	–
Kosten zurückgekaufter Anteile	(10.272)	(87)	(1.362.468)	(2.158.481)	–	(146.912)	(2.877)	(17.113)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**(9.258)**	**161**	**(284.186)**	**(713.928)**	**69**	**(141.829)**	**40.470**	**112.306**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(6.669)	658	(390.155)	(1.727.915)	(401)	(165.545)	8.881	66.557
NETTOVERMÖGEN, DAS INHABERN RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNEN IST								
Beginn des Zeitraums	76.139	78.105	6.981.869	9.565.643	35.483	209.846	729.516	409.521
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Zeitraums	**EUR 69.470**	**EUR 78.763**	**USD 6.591.714**	**USD 7.837.728**	**USD 35.082**	**USD 44.301**	**USD 738.397**	**USD 476.078**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		Legg Mason Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	
für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
USD (18.210)	**USD (89.070)**	**USD 4.402**	**USD 2.305**	**USD 125**	**USD (2.371)**	**USD 1.735**	**USD (2.372)**
38.991	120.575	43.717	43.250	1.441	1.974	2.550	11.959
812	815	1.864	2.373	287	212	969	1.005
(98.357)	(335.233)	(46.558)	(182.685)	(4.803)	(6.091)	(6.361)	(14.650)
(58.554)	**(213.843)**	**(977)**	**(137.062)**	**(3.075)**	**(3.905)**	**(2.842)**	**(1.686)**
(76.764)	(302.913)	3.425	(134.757)	(2.950)	(6.276)	(1.107)	(4.058)
731.259	1.075.509	151.256	310.835	24.193	31.705	37.502	41.359
–	–	–	–	–	–	–	–
USD654.495	**USD 772.596**	**USD 154.681**	**USD 176.078**	**USD 21.243**	**USD 25.429**	**USD 36.395**	**USD 37.301**

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	
für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
USD 13.877	**USD (7.412)**	**USD 6.534**	**USD 362**
35.679	28.508	4.560	35
–	–	–	30
(38.587)	(46.612)	(3.002)	(303)
(2.908)	**(18.104)**	**1.558**	**(238)**
10.969	(25.516)	8.092	124
249.893	201.610	68.916	67.817
–	–	–	–
USD260.862	**USD 176.094**	**USD 77.008**	**USD 67.941**

Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^		Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	
für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
USD 1.935	**USD (7.296)**	**USD 54.706**	**USD 27.383**	**USD 45.456**	**USD 11.786**	**USD 926**	**USD (7.735)**
3.653	613	387.455	698.928	1.829	–	17.749	314
–	2	16	–	–	–	–	–
(1.974)	(1.630)	(72.277)	(55.869)	(559)	–	(23.532)	(669)
1.679	**(1.015)**	**315.194**	**643.059**	**1.270**	**–**	**(5.783)**	**(355)**
3.614	(8.311)	369.900	670.442	46.726	11.786	(4.857)	(8.090)
49.474	95.160	1.176.879	930.495	893.938	947.330	116.682	119.297
–	–	–	–	–	–	–	–
USD 53.088	**USD 86.849**	**USD 1.546.779**	**USD 1.600.937**	**USD 940.664**	**USD 959.116**	**USD 111.825**	**USD 111.207**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^		Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**USD (4.772)**	**USD (117.065)**	**USD (68.702)**	**USD (146.424)**	**USD 2.307**	**USD (273)**	**USD 750**	**USD (65.382)**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	315.128	252.565	114.459	307.688	1.698	2.249	53.413	154.332
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	298	319	747	601	5	2	479	288
Kosten zurückgekaufter Anteile	(435.003)	(262.463)	(250.625)	(145.262)	(84.751)	(2.136)	(125.953)	(87.654)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**(119.577)**	**(9.579)**	**(135.419)**	**163.027**	**(83.048)**	**115**	**(72.061)**	**66.966**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(124.349)	(126.644)	(204.121)	16.603	(80.741)	(158)	(71.311)	1.584
NETTOVERMÖGEN, DAS INHABERN RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNEN IST								
Beginn des Zeitraums	1.060.603	1.317.108	1.208.431	1.335.605	97.564	97.291	651.830	659.927
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Zeitraums	**USD 936.254**	**USD 1.190.464**	**USD 1.004.310**	**USD 1.352.208**	**USD 16.823**	**USD 97.133**	**USD580.519**	**USD 661.511**

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^		Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^		Legg Mason ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**USD (58.898)**	**USD (65)**	**USD (97)**	**USD 40**	**USD 5.122**	**USD 18.331**	**USD (1.842)**	**USD (3.059)**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	76.412	22.501	–	144	17.888	30.376	983	12.928
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	1	–	2	2
Kosten zurückgekaufter Anteile	(616)	–	(1.304)	–	(22.095)	(21.614)	(15.620)	(1.299)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**75.796**	**22.501**	**(1.304)**	**144**	**(4.206)**	**8.762**	**(14.635)**	**11.631**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	16.898	22.436	(1.401)	184	916	27.093	(16.477)	8.572
NETTOVERMÖGEN, DAS INHABERN RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNEN IST								
Beginn des Zeitraums	352.883	–	4.731	4.748	342.500	345.899	32.059	40.292
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Zeitraums	**USD 369.781**	**USD 22.436**	**USD 3.330**	**USD 4.932**	**USD 343.416**	**USD 372.992**	**USD 15.582**	**USD 48.864**

(in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**USD 2.269**	**USD 2.994**	**USD 899**	**USD 616**	**USD (68.815)**	**USD 132.703**	**USD (5.270)**	**USD 17.123**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	2.678	2.790	3.678	5.216	53.817	474.219	2.707	19.965
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	11	23	1	8	–	–	–	–
Kosten zurückgekaufter Anteile	(11.653)	(10.142)	(591)	(77)	(356.949)	(439.975)	(17.230)	(65.721)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**(8.964)**	**(7.329)**	**3.088**	**5.147**	**(303.132)**	**34.244**	**(14.523)**	**(45.756)**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(6.695)	(4.335)	3.987	5.763	(371.947)	166.947	(19.793)	(28.633)
NETTOVERMÖGEN, DAS INHABERN RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNEN IST								
Beginn des Zeitraums	51.047	51.984	8.993	3.689	883.020	1.164.401	93.468	158.719
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Zeitraums	**USD 44.352**	**USD 47.649**	**USD 12.980**	**USD 9.452**	**USD 511.073**	**USD1.331.348**	**USD 73.675**	**USD 130.086**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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 das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
USD (32.125)	**USD (311.085)**	**USD 3.462**	**USD (12.092)**	**USD 1.724**	**USD 115**	**USD (507)**	**USD (2.296)**
93.498	174.784	16.193	25.882	4.012	16.229	–	–
–	–	18	50	–	–	–	–
(328.989)	(747.756)	25.423)	(28.981)	(7.227)	(8.859)	–	–
(235.491)	**(572.972)**	**(9.212)**	**(3.049)**	**(3.215)**	**7.370**	**–**	**–**
(267.616)	(884.057)	(5.750)	(15.141)	(1.491)	7.485	(507)	(2.296)
1.946.410	3.050.511	102.616	149.404	43.824	57.077	10.925	24.662
–	–	–	–	–	–	–	–
USD 1.678.794	**USD 2.166.454**	**USD 96.866**	**USD 134.263**	**USD 42.333**	**USD 64.562**	**USD 10.418**	**USD 22.366**

Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund		Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
USD 15.323	**USD 15.487**	**USD 91.827**	**USD 134.102**	**USD (39.592)**	**USD 147.289**
21.164	8.120	312.496	878.422	83.853	223.749
5	14	–	–	114	99
(28.130)	(77.117)	(524.770)	(456.187)	(460.807)	(402.008)
(6.961)	**(68.983)**	**(212.274)**	**422.235**	**(376.840)**	**(178.160)**
8.362	53.496)	(120.447)	556.337	(416.432)	(30.871)
200.451	274.333	1.452.635	1.016.226	1.530.684	1.839.077
–	–	–	–	–	–
USD208.813	**USD 220.837**	**USD 1.332.188**	**USD 1.572.563**	**USD 1.114.252**	**USD 1.808.206**

Legg Mason PCM US Equity Fund^		Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund		Legg Mason QS MV Asia Pacific ex Japan Equity Growth and Income Fonds	
für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
USD –	**USD –**	**EUR (931)**	**EUR 2.214**	**USD (6.250)**	**USD (5.122)**
–	–	3.589	6.070	23.731	44.176
–	–	–	–	100	77
–	–	(11.947)	(11.504)	(28.761)	(39.224)
–	**–**	**(8.358)**	**(5.434)**	**(4.930)**	**5.029**
–	–	(9.289)	(3.220)	(11.180)	(93)
–	–	53.197	65.247	86.466	84.587
–	–	–	–	–	–
USD –	**USD –**	**EUR 43.908**	**EUR 62.027**	**USD 75.286**	**USD 84.494**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Congruix Japan Equity Fund^		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**USD 70**	**USD 40**	**JPY –**	**JPY –**	**USD (8.684)**	**USD (6.749)**	**7.370**	**EUR 8.641**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	633	696	–	–	2.389	53.932	22.772	135.270
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	2	–	–
Kosten zurückgekaufter Anteile	(1.076)	(3.075)	–	–	(4.526)	(122)	(75.325)	(24.508)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**(443)**	**(2.379)**	–	–	**(2.137)**	**53.812**	**(52.553)**	**110.762**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(373)	(2.339)	–	–	(10.821)	47.063	(45.183)	119.403
NETTOVERMÖGEN, DAS INHABERN RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNEN IST								
Beginn des Zeitraums	13.371	17.970	–	–	254.638	185.243	274.976	205.205
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Zeitraums	**USD 12.998**	**USD 15.631**	**JPY –**	**JPY –**	**USD 243.817**	**USD 232.306**	**EUR 229.793**	**EUR 324.608**

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^		Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**USD 445**	**USD (2.252)**	**USD 1.689**	**USD 1.394**	**USD (552)**	**USD (2.628)**	**EUR 231**	**EUR –**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	75	145	1.409	87	1.740	14.745	2.774	–
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Kosten zurückgekaufter Anteile	(298)	(101)	(144)	(11)	(694)	(2.982)	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**(223)**	**44**	**1.265**	**76**	**1.046**	**11.763**	**2.774**	**–**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	222	(2.208)	2.954	1.470	494	9.135	3.005	–
NETTOVERMÖGEN, DAS INHABERN RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNEN IST								
Beginn des Zeitraums	15.839	18.003	23.230	21.800	26.193	15.224	2.800	–
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Zeitraums	**USD 16.061**	**USD 15.795**	**USD 26.184**	**USD 23.270**	**USD 26.687**	**USD 24.359**	**USD 26.687**	**USD 24.359**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

	Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^	
	für das sechs Monate bis 31. August 2019	für das sechs Monate bis 31. August 2018
	EUR 23.909	**EUR 22.559**
	158.009	34.053
	16	10
	(85.537)	(72.260)
	72.488	**(38.197)**
	96.397	(15.638)
	398.764	297.877
	–	–
	EUR 495.161	**EUR 282.239**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^ für das sechs Monate bis 31. August 2019	Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^ für das sechs Monate bis 31. August 2018	Legg Mason Global Funds Plc für das sechs Monate bis 31. August 2019	Legg Mason Global Funds Plc für das sechs Monate bis 31. August 2018
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**USD (60)**	**USD (544)**	**USD (29.105)**	**USD (1.385.546)**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN				
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	5	3	4.662.326	6.682.335
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	1	–	16.098	13.892
Kosten zurückgekaufter Anteile	–	–	(5.815.983)	(7.030.537)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**6**	**3**	**(1.137.559)**	**(334.310)**
Anstieg/(Rückgang) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile	(54)	(541)	(1.166.664)	(1.719.856)
NETTOVERMÖGEN, DAS INHABERN RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ZUZURECHNEN IST				
Beginn des Zeitraums	2.805	3.294	25.769.136	29.819.979
Währungsumrechnung	–	–	(46.157)	(57.292)
Ende des Zeitraums	**USD 2.751**	**USD 2.753**	**USD 4.556.315**	**USD 28.042.831**

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

Alle EUR-Beträge mit Ausnahme des den Inhabern rückzahlbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens zum Beginn des Berichtszeitraums 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 RARE Infrastructure Value Fund^ wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc zum 31. August 2019 unter Verwendung des USD/EUR-Wechselkurses der Gesamtergebnisrechnung für den Berichtszeitraum zum 31. August 2019 von 0,8912 in US-Dollar umgerechnet (31. August 2018: 0,8413).

Das Nettovermögen zu Anfang des Berichtszeitraums, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, für den Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, den Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, den Legg Mason 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 RARE Infrastructure Value Fund^ wurde zur Berechnung des Gesamtbetrags unter Verwendung des USD/EUR-Wechselkurses der Bilanz zum 28. Februar 2019 von 0,8578 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2018: 0,8664).

Alle Yen-Beträge, mit Ausnahme des den Inhabern rückzahlbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens zum Beginn des Berichtszeitraums für den wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc zum 31. August 2019 unter Verwendung des USD/JPY-Wechselkurses der Gesamtergebnisrechnung für den Zeitraum zum 31. August 2019 von 109,1769 in US-Dollar umgerechnet (31. August 2018: 109,2801).

Das Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, für den wurde zur Berechnung des Gesamtbetrags zu dem in der Bilanz verwendeten USD/JPY-Wechselkurs zum 28. Februar 2019 von 110,4493 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2018: 111,3949).

Alle britischen Pfund-Beträge, mit Ausnahme des den Inhabern rückzahlbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens zum Beginn des Zeitraums für den wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc zum 31. August 2019 unter Verwendung des USD/GBP-Wechselkurses der Gesamtergebnisrechnung für das Geschäftsjahr zum 31. August 2019 von 0,7870 in US-Dollar umgerechnet (31. August 2018: 0,7425).

Das Nettovermögen zu Anfang des Berichtszeitraums, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, wurde für den zur Berechnung des Gesamtbetrags unter Verwendung des USD/GBP-Wechselkurses der Bilanz zum 28. Februar 2019 von 0,7585 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2018: 0,7264).

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	37	44
Zurückgekauft	(14)	(82)
Nettozunahme/(-abnahme)	23	(38)
Klasse A USD ausschüttend (D)		
Verkauft	194	890
Zurückgekauft	(127)	(152)
Nettozunahme	67	738
Klasse B USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse B USD ausschüttend (D)		
Zurückgekauft	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	21	16
Zurückgekauft	(8)	(19)
Nettozunahme/(-abnahme)	13	(3)
Klasse C USD ausschüttend (D)		
Verkauft	8	15
Zurückgekauft	(2)	(18)
Nettozunahme/(-abnahme)	6	(3)
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	5	–
Nettozunahme	5	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	72	109
Zurückgekauft	(11)	(124)
Nettozunahme/(-abnahme)	61	(15)
Klasse F USD ausschüttend (D)		
Verkauft	30	9
Zurückgekauft	(5)	(4)
Nettozunahme	25	5
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	6	11
Zurückgekauft	(1)	–
Nettozunahme	5	11
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Klasse GA USD thesaurierend		
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	675	338
Zurückgekauft	(123)	(479)
Nettozunahme/(-abnahme)	552	(141)
Klasse A USD ausschüttend (D)		
Verkauft	173	103
Zurückgekauft	(109)	(106)
Nettozunahme/(-abnahme)	64	(3)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	35	1
Zurückgekauft	(45)	(16)
Nettoabnahme	(10)	(15)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	68	43
Zurückgekauft	(32)	–
Nettozunahme	36	43
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	16	10
Zurückgekauft	(2)	–
Nettozunahme	14	10
Klasse B USD ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	33	21
Zurückgekauft	(15)	(28)
Nettozunahme/(-abnahme)	18	(7)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse C USD ausschüttend (D)		
Verkauft	14	20
Zurückgekauft	(5)	(23)
Nettozunahme/(-abnahme)	9	(3)
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	58	26
Zurückgekauft	(22)	(34)
Nettozunahme/(-abnahme)	36	(8)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	1.514	897
Zurückgekauft	(352)	(796)
Nettozunahme	1.162	101
Klasse F USD ausschüttend (D)		
Verkauft	22	–
Nettozunahme	22	–
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	198	138
Zurückgekauft	(27)	(21)
Nettozunahme	171	117
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	3	–
Nettozunahme	3	–
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	955	1.102
Zurückgekauft	(360)	(296)
Nettozunahme	595	806
Klasse Premier USD ausschüttend (M)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	265	1.128
Zurückgekauft	(430)	(63)
Netto (abnahme)/-zunahme	(165)	1.065
Klasse LM USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(6)
Nettoabnahme	–	(6)
Klasse LM Euro thesaurierend		
Verkauft	2	–
Zurückgekauft	(2)	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	2
Zurückgekauft	(2)	(2)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)		
Verkauft	–	5
Zurückgekauft	–	(6)
Nettoabnahme	–	(1)
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Klasse A USD ausschüttend (D)		
Verkauft	2	–
Zurückgekauft	(2)	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse A Euro ausschüttend (D)		
Verkauft	5	2
Zurückgekauft	(7)	(3)
Nettoabnahme	(2)	(1)
Klasse C USD ausschüttend (D)		
Verkauft	–	2
Zurückgekauft	–	(3)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier Euro thesaurierend		
Verkauft	3	–
Nettozunahme	3	–
Klasse LM Euro thesaurierend		
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund – (Fortsetzung)		
Klasse GA Euro thesaurierend		
Zurückgekauft	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse GE Euro thesaurierend		
Zurückgekauft	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	5	27
Zurückgekauft	(4)	(51)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(24)
Klasse A USD ausschüttend (D)		
Verkauft	4	16
Zurückgekauft	(13)	(16)
Nettoabnahme	(9)	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Zurückgekauft	(5)	(1)
Nettoabnahme	(5)	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Zurückgekauft	–	(31)
Nettoabnahme	–	(31)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	–
Nettozunahme	5	–
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Zurückgekauft	(51)	(53)
Nettoabnahme	(51)	(53)
Klasse B USD ausschüttend (D)		
Zurückgekauft	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	14
Zurückgekauft	(4)	(9)
Netto (abnahme)/-zunahme	(4)	5
Klasse C USD ausschüttend (D)		
Verkauft	2	9
Zurückgekauft	–	(19)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(10)
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	2	34
Zurückgekauft	(7)	(35)
Nettoabnahme	(5)	(1)
Klasse L (G) USD thesaurierend		
Verkauft	–	7
Zurückgekauft	–	(7)
Nettozunahme	–	–
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	–
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	63	29
Zurückgekauft	(66)	(166)
Nettoabnahme	(3)	(137)
Klasse A USD ausschüttend (D)		
Verkauft	40	55
Zurückgekauft	(44)	(53)
Netto (abnahme)/-zunahme	(4)	2
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	2	1
Nettozunahme	2	1
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	8	13
Zurückgekauft	(11)	(70)
Nettoabnahme	(3)	(57)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	11	14
Zurückgekauft	(9)	(47)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(33)
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	14	12
Zurückgekauft	(16)	(14)
Nettoabnahme	(2)	(2)
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(1)	(7)
Nettoabnahme	–	(7)
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	–	9
Zurückgekauft	(1)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(1)	9
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	91	313
Zurückgekauft	(339)	(448)
Nettoabnahme	(248)	(135)
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse B USD ausschüttend (D)		
Verkauft	4	2
Zurückgekauft	(1)	(6)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(4)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	9	29
Zurückgekauft	(12)	(33)
Nettoabnahme	(3)	(4)
Klasse C USD ausschüttend (D)		
Verkauft	12	48
Zurückgekauft	(24)	(79)
Nettoabnahme	(12)	(31)
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	75	–
Zurückgekauft	(48)	–
Nettozunahme	27	–
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	3	2
Zurückgekauft	(4)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(2)
Klasse E USD ausschüttend (D)		
Verkauft	3	2
Zurückgekauft	(5)	(3)
Nettoabnahme	(2)	(1)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	5
Zurückgekauft	(1)	(9)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(4)
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	1	37
Zurückgekauft	(19)	(44)
Nettoabnahme	(18)	(7)
Klasse F USD ausschüttend (D)		
Verkauft	11	73
Zurückgekauft	(11)	(37)
Nettozunahme	–	36
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(1)	–
Nettozunahme	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)		
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	21	–
Zurückgekauft	(51)	(64)
Nettoabnahme	(30)	(64)
Klasse Premier USD ausschüttend (M)		
Verkauft	60	60
Zurückgekauft	(232)	(284)
Nettoabnahme	(172)	(224)
Klasse Premier CHF, thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgekauft	(264)	–
Nettoabnahme	(264)	–
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	11	6
Zurückgekauft	(8)	(14)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(8)
Klasse Premier Euro ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	3
Zurückgekauft	–	(2)
Nettozunahme	–	1
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	–	(776)
Nettoabnahme	–	(776)
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)		
Zurückgekauft	(5)	(546)
Nettoabnahme	(5)	(546)
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	1	806
Zurückgekauft	(14)	(132)
Netto (abnahme)/-zunahme	(13)	674
Klasse Premier GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)		
Verkauft	–	3
Zurückgekauft	(1)	(111)
Nettoabnahme	(1)	(108)
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	46	250
Zurückgekauft	–	(355)
Nettozunahme/(-abnahme)	46	(105)
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	27	43
Zurückgekauft	(46)	(9)
Netto (abnahme)/-zunahme	(19)	34
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	–	(84)
Nettoabnahme	–	(84)
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	126	196
Zurückgekauft	(121)	(164)
Nettozunahme	5	32
Klasse A USD ausschüttend (D)		
Verkauft	72	122
Zurückgekauft	(79)	(226)
Nettoabnahme	(7)	(104)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	10	4
Zurückgekauft	(4)	(36)
Nettozunahme/(-abnahme)	6	(32)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	4	1
Zurückgekauft	(1)	(12)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(11)
Klasse A Euro ausschüttend (M (abgesichert)		
Verkauft	15	11
Zurückgekauft	(9)	(11)
Nettozunahme	6	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	327	186
Zurückgekauft	(383)	(312)
Nettoabnahme	(56)	(126)
Klasse B USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse B USD ausschüttend (D)		
Verkauft	–	11
Zurückgekauft	(3)	(26)
Nettoabnahme	(3)	(15)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	14	18
Zurückgekauft	(6)	(24)
Nettozunahme/(-abnahme)	8	(6)
Klasse C USD ausschüttend (D)		
Verkauft	5	44
Zurückgekauft	(11)	(64)
Nettoabnahme	(6)	(20)
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	1	12
Zurückgekauft	(4)	(18)
Nettoabnahme	(3)	(6)
Klasse E USD ausschüttend (D)		
Verkauft	1	5
Zurückgekauft	(3)	(15)
Nettoabnahme	(2)	(10)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	2	7
Zurückgekauft	(1)	(66)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(59)
Klasse F USD ausschüttend (D)		
Verkauft	1	2
Zurückgekauft	(1)	(2)
Nettozunahme	–	–
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Zurückgekauft	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	82	64
Zurückgekauft	(49)	(777)
Nettozunahme/(-abnahme)	33	(713)
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	–
Nettozunahme	3	–
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	13	19
Zurückgekauft	(84)	(106)
Nettoabnahme	(71)	(87)
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	9
Zurückgekauft	(4)	(13)
Nettoabnahme	(3)	(4)
Klasse L (G) USD thesaurierend		
Verkauft	–	2
Zurückgekauft	(1)	(2)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)		
Verkauft	2	10
Zurückgekauft	(4)	(16)
Nettoabnahme	(2)	(6)
Klasse GF USD thesaurierend		
Zurückgekauft	(13)	–
Nettoabnahme	(13)	–
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	4	7
Zurückgekauft	(5)	(9)
Nettoabnahme	(1)	(2)
Klasse A USD ausschüttend (D)		
Verkauft	1	9
Zurückgekauft	(2)	(17)
Nettoabnahme	(1)	(8)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(1)	(7)
Nettoabnahme	–	(7)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	3	1
Zurückgekauft	(5)	(16)
Nettoabnahme	(2)	(15)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	40	30
Zurückgekauft	(26)	(290)
Nettozunahme/(-abnahme)	14	(260)
Klasse B USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse B USD ausschüttend (D)		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	4	4
Zurückgekauft	(5)	(3)
Netto (abnahme)/-zunahme	(1)	1
Klasse C USD ausschüttend (D)		
Verkauft	1	18
Zurückgekauft	(4)	(18)
Nettoabnahme	(3)	–
Klasse E USD ausschüttend (D)		
Verkauft	–	18
Zurückgekauft	(3)	(17)
Netto (abnahme)/-zunahme	(3)	1
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	–	4
Zurückgekauft	(5)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(5)	4
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	(1)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(3)
Klasse Premier GBP ausschüttend (D) (abgesichert)		
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	2
Zurückgekauft	(1)	(3)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse L (G) USD thesaurierend		
Verkauft	–	7
Zurückgekauft	(1)	(7)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)		
Verkauft	4	19
Zurückgekauft	(4)	(19)
Nettozunahme	–	–

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	36	136
Zurückgekauft	(65)	(154)
Nettoabnahme	(29)	(18)
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	76	8
Zurückgekauft	(118)	(57)
Nettoabnahme	(42)	(49)
Klasse A USD ausschüttend (D)		
Verkauft	5	62
Zurückgekauft	(21)	(94)
Nettoabnahme	(16)	(32)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	14	18
Zurückgekauft	(16)	(96)
Nettoabnahme	(2)	(78)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	8	10
Zurückgekauft	(20)	(108)
Nettoabnahme	(12)	(98)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	7	6
Zurückgekauft	(24)	(41)
Nettoabnahme	(17)	(35)
Klasse A Euro thesaurierend		
Zurückgekauft	(2)	(5)
Nettoabnahme	(2)	(5)
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Verkauft	9	10
Zurückgekauft	(6)	(10)
Nettozunahme	3	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	1.710	1.128
Zurückgekauft	(1.123)	(1.200)
Nettozunahme/(-abnahme)	587	(72)
Klasse B USD ausschüttend (D)		
Zurückgekauft	(3)	(1)
Nettoabnahme	(3)	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	1	6
Zurückgekauft	(1)	(6)
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD ausschüttend (D)		
Verkauft	2	13
Zurückgekauft	(7)	(19)
Nettoabnahme	(5)	(6)
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	4	–
Zurückgekauft	(6)	–
Nettoabnahme	(2)	–
Klasse E USD ausschüttend (D)		
Verkauft	1	2
Zurückgekauft	–	(3)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	1	2
Zurückgekauft	(2)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(2)
Klasse F USD ausschüttend (D)		
Verkauft	2	54
Zurückgekauft	(2)	(21)
Nettozunahme	–	33

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)		
Klasse X USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	6	13
Zurückgekauft	–	(4)
Nettozunahme	6	9
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Verkauft	4	6
Zurückgekauft	–	(2)
Nettozunahme	4	4
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	17	14
Zurückgekauft	(23)	(9)
Netto (abnahme)/-zunahme	(6)	5
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	23	301
Zurückgekauft	(67)	(329)
Nettoabnahme	(44)	(28)
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	28	1
Zurückgekauft	(46)	(3)
Nettoabnahme	(18)	(2)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	2	53
Zurückgekauft	(14)	(162)
Nettoabnahme	(12)	(109)
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	2	1
Zurückgekauft	(3)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(3)
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	2	3
Zurückgekauft	(3)	(15)
Nettoabnahme	(1)	(12)
Klasse L (G) USD thesaurierend		
Verkauft	–	4
Zurückgekauft	–	(5)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)		
Verkauft	4	12
Zurückgekauft	(5)	(19)
Nettoabnahme	(1)	(7)
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	2	22
Zurückgekauft	(5)	(22)
Nettoabnahme	(3)	–
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	6	22
Zurückgekauft	(23)	(15)
Netto (abnahme)/-zunahme	(17)	7
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	8
Zurückgekauft	(4)	(6)
Netto (abnahme)/-zunahme	(4)	2
Klasse C USD ausschüttend (A)		
Verkauft	–	4
Zurückgekauft	–	(3)
Nettozunahme	–	1
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	–	18
Zurückgekauft	–	(8)
Nettozunahme	–	10
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	(3)	–
Nettoabnahme	(3)	–

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	103	297
Zurückgekauft	(241)	(338)
Nettoabnahme	(138)	(41)
Klasse A USD ausschüttend (D)		
Verkauft	16	22
Zurückgekauft	(20)	(24)
Nettoabnahme	(4)	(2)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	384	66
Zurückgekauft	(232)	(207)
Nettozunahme/(-abnahme)	152	(141)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	94	17
Zurückgekauft	(60)	(61)
Nettozunahme/(-abnahme)	34	(44)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	218	48
Zurückgekauft	(84)	(62)
Nettozunahme/(-abnahme)	134	(14)
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	846	113
Zurückgekauft	(217)	(137)
Nettozunahme/(-abnahme)	629	(24)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	7	2
Zurückgekauft	(7)	(113)
Nettoabnahme	–	(111)
Klasse A Euro thesaurierend		
Verkauft	13	–
Zurückgekauft	(7)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	6	(1)
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse A GBP ausschüttend (M)		
Zurückgekauft	–	(4)
Nettoabnahme	–	(4)
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	905	357
Zurückgekauft	(1.413)	(609)
Nettoabnahme	(508)	(252)
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	360	31
Zurückgekauft	(975)	(394)
Nettoabnahme	(615)	(363)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	232	2.537
Zurückgekauft	(242)	(2.807)
Nettoabnahme	(10)	(270)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	830	21
Zurückgekauft	(25)	(92)
Nettozunahme/(-abnahme)	805	(71)
Klasse B USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	3
Zurückgekauft	–	(8)
Nettoabnahme	–	(5)
Klasse C USD ausschüttend (D)		
Verkauft	–	5
Zurückgekauft	(3)	(13)
Nettoabnahme	(3)	(8)
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	1	3
Zurückgekauft	(2)	(3)
Nettoabnahme	(1)	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – (Fortsetzung)		
Klasse E USD ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(1)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	3	3
Zurückgekauft	(5)	(44)
Nettoabnahme	(2)	(41)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	–	37
Zurückgekauft	–	(2)
Nettozunahme	–	35
Klasse X USD ausschüttend (M)		
Verkauft	–	124
Zurückgekauft	(3)	(236)
Nettoabnahme	(3)	(112)
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	(6)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(6)	1
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	9
Zurückgekauft	(9)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(9)	9
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	11	115
Zurückgekauft	(44)	(185)
Nettoabnahme	(33)	(70)
Klasse Premier USD ausschüttend (M)		
Verkauft	134	93
Zurückgekauft	(182)	(187)
Nettoabnahme	(48)	(94)
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	29	–
Zurückgekauft	(45)	(1)
Nettoabnahme	(16)	(1)
Klasse Premier Euro thesaurierend		
Verkauft	130	–
Zurückgekauft	(130)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	29	418
Zurückgekauft	–	(361)
Nettozunahme	29	57
Klasse Premier GBP ausschüttend (M)		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	2	–
Zurückgekauft	(2)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	3	–
Zurückgekauft	(3)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Zurückgekauft	–	(2)
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD, ausschüttend (M)		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	–	9
Zurückgekauft	(4)	(25)
Nettoabnahme	(4)	(16)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse E USD ausschüttend (D)		
Zurückgekauft	(9)	(1)
Nettoabnahme	(9)	(1)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	4	–
Zurückgekauft	(4)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	–
Nettozunahme	5	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	1	15
Zurückgekauft	(3)	(39)
Nettoabnahme	(2)	(24)
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	60	28
Zurückgekauft	(2)	(5)
Nettozunahme	58	23
Klasse S Euro, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	20	3
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	20	2
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	892	444
Zurückgekauft	(42)	(13)
Nettozunahme	850	431
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	12	–
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	12	(1)
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	81	259
Zurückgekauft	(241)	(393)
Nettoabnahme	(160)	(134)
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	15	60
Zurückgekauft	(2)	(57)
Nettozunahme	13	3
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	88	–
Zurückgekauft	(64)	–
Nettozunahme	24	–
Klasse LM CAD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	188	–
Nettozunahme	188	–
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	33	1
Zurückgekauft	(7)	(1)
Nettozunahme	26	–
Klasse A USD ausschüttend (D)		
Zurückgekauft	(16)	(1)
Nettoabnahme	(16)	(1)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund		
Klasse A Euro ausschüttend (D)		
Verkauft	2	–
Zurückgekauft	(2)	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier Euro thesaurierend		
Verkauft	5	–
Nettozunahme	5	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse LM Euro thesaurierend		
Zurückgekauft	(58)	–
Nettoabnahme	(58)	–
Klasse LM Euro ausschüttend (Q)		
Verkauft	2	2
Nettozunahme	2	2
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	1.105	1.827
Zurückgekauft	(2.095)	(3.400)
Nettoabnahme	(990)	(1.573)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	964	496
Zurückgekauft	(921)	(869)
Nettozunahme/(-abnahme)	43	(373)
Klasse A USD ausschüttend (S)		
Verkauft	72	183
Zurückgekauft	(555)	(528)
Nettoabnahme	(483)	(345)
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	32	29
Zurückgekauft	(1)	(9)
Nettozunahme	31	20
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	249	54
Zurückgekauft	(40)	(39)
Nettozunahme	209	15
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	6	39
Zurückgekauft	(23)	(70)
Nettoabnahme	(17)	(31)
Klasse A CNH thesaurierend (mit Absicherung)		
Verkauft	4	3
Zurückgekauft	(129)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(125)	3
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	12	–
Zurückgekauft	(7)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(2)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	577	1.238
Zurückgekauft	(1.230)	(1.183)
Netto (abnahme)/-zunahme	(653)	55
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	29	10
Zurückgekauft	(16)	(29)
Nettozunahme/(-abnahme)	13	(19)
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	321	–
Nettozunahme	321	–
Klasse A Euro ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	20	56
Zurückgekauft	(68)	(28)
Netto (abnahme)/-zunahme	(48)	28
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	295	238
Zurückgekauft	(19)	(38)
Nettozunahme	276	200
Klasse A GBP thesaurierend		
Zurückgekauft	(4)	(3)
Nettoabnahme	(4)	(3)
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	75	58
Zurückgekauft	(9)	(2)
Nettozunahme	66	56
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	121	415
Zurückgekauft	(288)	(502)
Nettoabnahme	(167)	(87)
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	23.417	7.405
Zurückgekauft	(33.458)	(13.951)
Nettoabnahme	(10.041)	(6.546)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	52.564	12.052
Zurückgekauft	(11.666)	(13.652)
Nettozunahme/(-abnahme)	40.898	(1.600)
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	4.969
Zurückgekauft	–	(61)
Nettozunahme	–	4.908
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	–	9
Zurückgekauft	–	(8)
Nettozunahme	–	1
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	65	369
Zurückgekauft	(136)	(364)
Netto (abnahme)/-zunahme	(71)	5
Klasse C USD ausschüttend (S)		
Verkauft	5	87
Zurückgekauft	(24)	(80)
Netto (abnahme)/-zunahme	(19)	7
Klasse A NOK thesaurierend (mit Absicherung)		
Verkauft	34	25
Zurückgekauft	(15)	(8)
Nettozunahme	19	17
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	62	109
Zurückgekauft	(78)	(124)
Nettoabnahme	(16)	(15)
Klasse E USD ausschüttend (S)		
Verkauft	1	13
Zurückgekauft	(9)	(15)
Nettoabnahme	(8)	(2)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	10	38
Zurückgekauft	(10)	(16)
Nettozunahme	–	22
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	290	866
Zurückgekauft	(237)	(675)
Nettozunahme	53	191
Klasse F USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	28	87
Zurückgekauft	(44)	(79)
Netto (abnahme)/-zunahme	(16)	8
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	468	417
Zurückgekauft	(488)	(803)
Nettoabnahme	(20)	(386)
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	87	609
Zurückgekauft	(69)	(126)
Nettozunahme	18	483
Klasse X USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	34	29
Zurückgekauft	(29)	(355)
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(326)
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	22	29
Zurückgekauft	(31)	(88)
Nettoabnahme	(9)	(59)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	327	832
Zurückgekauft	(447)	(1.162)
Nettoabnahme	(120)	(330)
Klasse X EUR thesaurierend		
Verkauft	52	34
Zurückgekauft	(2)	(31)
Nettozunahme	50	3
Klasse X EUR ausschüttend (A) (mit Absicherung)		
Verkauft	19	133
Zurückgekauft	(26)	(110)
Netto (abnahme)/-zunahme	(7)	23
Klasse X EUR ausschüttend (M) (mit Absicherung)		
Verkauft	–	24
Zurückgekauft	–	(7)
Nettozunahme	–	17

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)		
Verkauft	116	217
Zurückgekauft	(140)	(286)
Nettoabnahme	(24)	(69)
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	9	7
Zurückgekauft	(3)	(4)
Nettozunahme	6	3
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	18	13
Zurückgekauft	(9)	(1)
Nettozunahme	9	12
Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2.161	426
Zurückgekauft	(618)	(2.068)
Nettozunahme/(-abnahme)	1.543	(1.642)
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	1.111	679
Zurückgekauft	(1.561)	(3.099)
Nettoabnahme	(450)	(2.420)
Klasse Premier USD ausschüttend (S)		
Verkauft	350	227
Zurückgekauft	(106)	(133)
Nettozunahme	244	94
Klasse Premier AUD thesaurierend (mit Absicherung)		
Verkauft	41	3
Zurückgekauft	(41)	(5)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse Premier AUD ausschüttend (S) (mit Absicherung)		
Verkauft	142	120
Zurückgekauft	(211)	(44)
Netto (abnahme)/-zunahme	(69)	76
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	543
Zurückgekauft	(445)	(4.374)
Nettoabnahme	(445)	(3.831)
Klasse Premier CHF, thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	43	101
Zurückgekauft	(112)	(64)
Netto (abnahme)/-zunahme	(69)	37
Klasse Premier CHF ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	1	28
Zurückgekauft	(13)	(17)
Netto (abnahme)/-zunahme	(12)	11
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	910	1.619
Zurückgekauft	(1.436)	(2.266)
Nettoabnahme	(526)	(647)
Klasse Premier Euro thesaurierend		
Verkauft	51	10
Zurückgekauft	(2)	(33)
Nettozunahme/(-abnahme)	49	(23)
Klasse Premier EUR ausschüttend (S) (mit Absicherung)		
Verkauft	121	198
Zurückgekauft	(100)	(169)
Nettozunahme	21	29
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	378	475
Zurückgekauft	(619)	(563)
Nettoabnahme	(241)	(88)
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)		
Verkauft	1.348	872
Zurückgekauft	(651)	(466)
Nettozunahme	697	406
Klasse Premier JPY thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	21	556
Zurückgekauft	(2)	–
Nettozunahme	19	556
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	28	41
Zurückgekauft	–	(4)
Nettozunahme	28	37
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	60	140
Zurückgekauft	(41)	(142)
Nettozunahme/(-abnahme)	19	(2)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	–	5
Zurückgekauft	(97)	(158)
Nettoabnahme	(97)	(153)
Klasse S Euro, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	19	1
Zurückgekauft	(167)	(6)
Nettoabnahme	(148)	(5)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse LM AUD ausschüttend (S) (mit Absicherung)		
Verkauft	115	172
Zurückgekauft	(255)	(82)
Netto (abnahme)/-zunahme	(140)	90
Klasse LM Euro thesaurierend		
Verkauft	2	–
Zurückgekauft	(1)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(2)
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^		
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	–	38
Zurückgekauft	–	(1.241)
Nettoabnahme	–	(1.203)
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	1	1
Nettozunahme	1	1
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^		
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgekauft	–	(4)
Nettoabnahme	–	(4)
Klasse X CHF ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	4
Zurückgekauft	–	(33)
Nettoabnahme	–	(29)
Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	2
Zurückgekauft	–	(17)
Nettoabnahme	–	(15)
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	9	–
Nettozunahme	9	–
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	155	100
Nettozunahme	155	100
Klasse LM Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	212	–
Nettozunahme	212	–
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	646	748
Zurückgekauft	(618)	(72)
Nettozunahme	28	676
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgekauft	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Zurückgekauft	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	(3)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(3)	1
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	32	3
Zurückgekauft	(7)	(6)
Nettozunahme/(-abnahme)	25	(3)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	1
Zurückgekauft	(5)	(7)
Nettoabnahme	(2)	(6)
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^		
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse D Euro, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	14
Zurückgekauft	(8)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(3)	14
Klasse D Euro ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	16	17
Zurückgekauft	–	(10)
Nettozunahme	16	7
Klasse D USD, thesaurierend		
Verkauft	10	256
Zurückgekauft	(55)	(26)
Netto (abnahme)/-zunahme	(45)	230
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	–	20
Nettozunahme	–	20
Klasse D USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	11	143
Zurückgekauft	(54)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(43)	143
Klasse M CHF thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	2
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettozunahme	4	1
Klasse M GBP ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	2
Nettozunahme	–	2
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	–	48
Zurückgekauft	(42)	(5)
Netto (abnahme)/-zunahme	(42)	43
Klasse M Euro, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	4
Zurückgekauft	(1)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(1)	4
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	865	2.901
Zurückgekauft	(170)	(150)
Nettozunahme	695	2.751
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)		
Verkauft	18	38
Zurückgekauft	(3)	–
Nettozunahme	15	38
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1.817	1.444
Zurückgekauft	(269)	(202)
Nettozunahme	1.548	1.242
Klasse Premier Euro ausschüttend (Q) (abgesichert)		
Verkauft	73	215
Zurückgekauft	(9)	(82)
Nettozunahme	64	133
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)		
Verkauft	62	362
Zurückgekauft	(5)	–
Nettozunahme	57	362
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	9	8
Zurückgekauft	(8)	–
Nettozunahme	1	8

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	3	–
Zurückgekauft	(3)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	10	–
Zurückgekauft	(1)	–
Nettozunahme	9	–
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	2	–
Zurückgekauft	(2)	–
Nettozunahme	–	–
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	9	3
Zurückgekauft	(6)	(7)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(4)
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	160	–
Nettozunahme	160	–
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	–
Nettozunahme	3	–
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	(162)	–
Nettoabnahme	(162)	–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	36	87
Zurückgekauft	(96)	(59)
Netto (abnahme)/-zunahme	(60)	28
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	24	43
Zurückgekauft	(26)	(42)
Netto (abnahme)/-zunahme	(2)	1
Klasse A USD ausschüttend (S)		
Verkauft	69	59
Zurückgekauft	(34)	(41)
Nettozunahme	35	18
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	18	–
Zurückgekauft	(2)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	16	(2)
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	302	34
Zurückgekauft	(75)	(94)
Nettozunahme/(-abnahme)	227	(60)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	62	94
Zurückgekauft	(483)	(138)
Nettoabnahme	(421)	(44)
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	1	3
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	1	2
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	6	6
Zurückgekauft	(16)	(56)
Nettoabnahme	(10)	(50)
Klasse A GBP thesaurierend		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	2
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	–	1

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	2	4
Zurückgekauft	(5)	(72)
Nettoabnahme	(3)	(68)
Klasse A SGD thesaurierend		
Verkauft	13.389	55
Zurückgekauft	(13.402)	(1.233)
Nettoabnahme	(13)	(1.178)
Klasse B USD ausschüttend (S)		
Verkauft	–	2
Zurückgekauft	–	(4)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	5	2
Zurückgekauft	(5)	(3)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD ausschüttend (S)		
Verkauft	4	12
Zurückgekauft	(14)	(13)
Nettoabnahme	(10)	(1)
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	1	4
Zurückgekauft	(5)	(6)
Nettoabnahme	(4)	(2)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	3	2
Zurückgekauft	(8)	(7)
Nettoabnahme	(5)	(5)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	3	11
Zurückgekauft	(6)	(6)
Netto (abnahme)/-zunahme	(3)	5
Klasse F USD, ausschüttend (S)		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	8	35
Zurückgekauft	(11)	(96)
Nettoabnahme	(3)	(61)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	29	37
Zurückgekauft	(68)	(36)
Netto (abnahme)/-zunahme	(39)	1
Klasse X USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	4	11
Zurückgekauft	(5)	(1)
Netto (abnahme)/-zunahme	(1)	10
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	43	95
Zurückgekauft	(79)	(81)
Netto (abnahme)/-zunahme	(36)	14
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	32	94
Zurückgekauft	(824)	(30)
Netto (abnahme)/-zunahme	(792)	64
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	14	10
Zurückgekauft	(23)	(6)
Netto (abnahme)/-zunahme	(9)	4
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung) (IH)		
Verkauft	18	11
Zurückgekauft	(18)	(11)
Nettozunahme	–	–
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)		
Verkauft	46	19
Zurückgekauft	(17)	(5)
Nettozunahme	29	14
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	94	237
Zurückgekauft	(269)	(138)
Netto (abnahme)/-zunahme	(175)	99
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	119	119
Zurückgekauft	(245)	(31)
Netto (abnahme)/-zunahme	(126)	88

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	53	135
Zurückgekauft	(50)	(20)
Nettozunahme	3	115
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	504	428
Zurückgekauft	(504)	(189)
Nettozunahme	–	239
Klasse Premier USD ausschüttend (S)		
Verkauft	184	6
Zurückgekauft	(165)	(5)
Nettozunahme	19	1
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	114	124
Zurückgekauft	(160)	(312)
Nettoabnahme	(46)	(188)
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	494	74
Zurückgekauft	(151)	(305)
Nettozunahme/(-abnahme)	343	(231)
Klasse Premier Euro thesaurierend		
Verkauft	84	112
Zurückgekauft	(175)	(133)
Nettoabnahme	(91)	(21)
Klasse Premier EUR ausschüttend (S)		
Verkauft	2	1
Zurückgekauft	(2)	(2)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	29	80
Zurückgekauft	(43)	(30)
Netto (abnahme)/-zunahme	(14)	50
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	99	2
Zurückgekauft	(43)	(23)
Nettozunahme/(-abnahme)	56	(21)
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	91	–
Zurückgekauft	(64)	(9)
Nettozunahme/(-abnahme)	27	(9)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	31	–
Zurückgekauft	(1)	–
Nettozunahme	30	–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	1	17
Zurückgekauft	(10)	(14)
Netto (abnahme)/-zunahme	(9)	3
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	4	2
Zurückgekauft	(2)	(2)
Nettozunahme	2	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	4
Zurückgekauft	(5)	(32)
Nettoabnahme	(5)	(28)
Klasse A SGD thesaurierend		
Verkauft	4.404	7.085
Zurückgekauft	(4.404)	(11.069)
Nettoabnahme	–	(3.984)
Klasse C USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	1	5
Zurückgekauft	(3)	(1)
Netto (abnahme)/-zunahme	(2)	4
Klasse E USD ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Zurückgekauft	(2)	(55)
Nettoabnahme	(2)	(53)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Zurückgekauft	–	(20)
Nettoabnahme	–	(20)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	1	7
Zurückgekauft	(7)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(6)	7
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	30
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	–	29
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	6	1
Zurückgekauft	(3)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(1)
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	139	370
Zurückgekauft	(333)	(131)
Netto (abnahme)/-zunahme	(194)	239
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	5
Zurückgekauft	(2)	–
Nettozunahme	–	5
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	13	691
Zurückgekauft	(369)	(411)
Netto (abnahme)/-zunahme	(356)	280
Klasse Premier Euro ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	19	19
Zurückgekauft	(107)	(20)
Nettoabnahme	(88)	(1)
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	10	58
Zurückgekauft	(45)	(12)
Netto (abnahme)/-zunahme	(35)	46
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	169
Zurückgekauft	–	(105)
Nettozunahme	–	64
Klasse Premier SGD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	21
Zurückgekauft	–	(44.079)
Nettoabnahme	–	(44.058)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	–	87
Zurückgekauft	(365)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(365)	87
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	995	1.411
Zurückgekauft	(889)	–
Nettozunahme	106	1.411
Klasse LM Euro thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	–	(126)
Nettoabnahme	–	(126)
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	(161)	(44)
Nettoabnahme	(161)	(44)
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	6	13
Zurückgekauft	(3)	(2)
Nettozunahme	3	11
Klasse A USD ausschüttend (D)		
Verkauft	5	–
Zurückgekauft	(1)	–
Nettozunahme	4	–
Klasse F USD ausschüttend (D)		
Verkauft	5	–
Nettozunahme	5	–

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	–	4
Zurückgekauft	(13)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(13)	4
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Zurückgekauft	–	(13)
Nettoabnahme	–	(13)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	(720)	–
Nettoabnahme	(720)	–
Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	4
Nettozunahme	–	4
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	6	54
Zurückgekauft	(8)	(17)
Netto (abnahme)/-zunahme	(2)	37
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	133	9
Zurückgekauft	(129)	(5)
Nettozunahme	4	4
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse A SGD thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(3.360)
Nettoabnahme	–	(3.360)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	2	9
Zurückgekauft	(3)	(5)
Netto (abnahme)/-zunahme	(1)	4
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	11	17
Zurückgekauft	(13)	(23)
Nettoabnahme	(2)	(6)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	2	26
Zurückgekauft	(3)	(18)
Netto (abnahme)/-zunahme	(1)	8
Klasse F USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	1	15
Zurückgekauft	(1)	(14)
Nettozunahme	–	1
Klasse Premier USD thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	137
Zurückgekauft	–	(149)
Nettoabnahme	–	(12)
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	1.130	906
Zurückgekauft	(1.677)	(367)
Netto (abnahme)/-zunahme	(547)	539
Klasse Premier USD ausschüttend (M)		
Verkauft	–	23
Zurückgekauft	(86)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(86)	23
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Zurückgekauft	–	(47)
Nettoabnahme	–	(47)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	18	2
Zurückgekauft	(1)	–
Nettozunahme	17	2
Klasse LM USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	(98)	(21)
Nettoabnahme	(98)	(21)
Klasse LM Euro thesaurierend		
Verkauft	8	1
Zurückgekauft	(4)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	4	(4)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse LM NZD thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	151	1.614
Zurückgekauft	(62)	(1.607)
Nettozunahme	89	7
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
BW Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	1.000	–
Nettozunahme	1.000	–
BW Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Zurückgekauft	(1.031)	–
Nettoabnahme	(1.031)	–
BW Klasse LM GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Zurückgekauft	–	(3.651)
Nettoabnahme	–	(3.651)
Klasse BW Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	761	1.105
Zurückgekauft	(567)	–
Nettozunahme	194	1.105
Klasse BW Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	13
Zurückgekauft	(750)	(191)
Nettoabnahme	(750)	(178)
Klasse BW Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	242
Zurückgekauft	–	(1.471)
Nettoabnahme	–	(1.229)
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	20	6
Zurückgekauft	(3)	(1)
Nettozunahme	17	5
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	3	15
Zurückgekauft	(81)	(81)
Nettoabnahme	(78)	(66)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	28
Zurückgekauft	(21)	(37)
Nettoabnahme	(16)	(9)
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	10	19
Zurückgekauft	(8)	(7)
Nettozunahme	2	12
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	15	23
Zurückgekauft	(28)	(30)
Nettoabnahme	(13)	(7)
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(2)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	2.148	18
Zurückgekauft	(1.651)	(27)
Nettozunahme/(-abnahme)	497	(9)
Klasse C USD ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse F USD ausschüttend (D)		
Verkauft	10	–
Nettozunahme	10	–
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	3
Zurückgekauft	(3)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(3)	3
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	1	1
Zurückgekauft	–	(6)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(5)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	13	6
Zurückgekauft	(14)	(11)
Nettoabnahme	(1)	(5)
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	1	3
Zurückgekauft	(9)	(8)
Nettoabnahme	(8)	(5)
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	33	22
Zurückgekauft	(34)	(23)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse Premier Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	7	95
Zurückgekauft	(12)	(47)
Netto (abnahme)/-zunahme	(5)	48
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	188	3
Zurückgekauft	(392)	(198)
Nettoabnahme	(204)	(195)
Klasse S Euro, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	14	11
Zurückgekauft	(11)	–
Nettozunahme	3	11
Klasse S Euro, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	14	–
Nettozunahme	14	–
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	–	3
Zurückgekauft	(3)	(3)
Nettoabnahme	(3)	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	11
Nettozunahme	–	11
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	23	202
Zurückgekauft	(47)	(150)
Netto (abnahme)/-zunahme	(24)	52
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	(99)	–
Nettoabnahme	(99)	–
Klasse S BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	103	–
Nettozunahme	103	–
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	–	25
Nettozunahme	–	25
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	–	90
Nettozunahme	–	90
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	8
Nettozunahme	–	8
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	31	90
Zurückgekauft	(6)	–
Nettozunahme	25	90
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	9
Nettozunahme	–	9

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse LM SGD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	96.246	14
Nettozunahme	96.246	14
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	(1)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(1)	1
Klasse Premier USD thesaurierend		
Zurückgekauft	(2)	–
Nettoabnahme	(2)	–
Klasse S Euro, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	(6)	–
Nettoabnahme	(6)	–
Legg Mason ClearBridge Value Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	63	73
Zurückgekauft	(52)	(38)
Nettozunahme	11	35
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	4	10
Zurückgekauft	(13)	(23)
Nettoabnahme	(9)	(13)
Klasse A Euro thesaurierend		
Verkauft	10	2
Zurückgekauft	(22)	(4)
Nettoabnahme	(12)	(2)
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	300
Zurückgekauft	(56)	(122)
Netto (abnahme)/-zunahme	(51)	178
Klasse A SGD thesaurierend		
Verkauft	405	139
Zurückgekauft	(541)	(495)
Nettoabnahme	(136)	(356)
Klasse B USD ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	5
Zurückgekauft	(2)	(6)
Nettoabnahme	(2)	(1)
Klasse C USD ausschüttend (A)		
Verkauft	–	10
Zurückgekauft	(1)	(11)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	1	14
Zurückgekauft	–	(7)
Nettozunahme	1	7
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	47	106
Zurückgekauft	(51)	(71)
Netto (abnahme)/-zunahme	(4)	35
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	(1)	(2)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse Premier Euro thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(3)	(1)
Nettoabnahme	(2)	(1)
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	–	3
Zurückgekauft	–	(5)
Nettoabnahme	–	(2)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Zurückgekauft	–	(2)
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	9	100
Zurückgekauft	(148)	(8)
Netto (abnahme)/-zunahme	(139)	92
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	–	11
Zurückgekauft	(6)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(6)	11
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	28	90
Zurückgekauft	(30)	(98)
Nettoabnahme	(2)	(8)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	3	37
Zurückgekauft	(16)	(47)
Nettoabnahme	(13)	(10)
Klasse A Euro thesaurierend		
Verkauft	1	2
Zurückgekauft	(8)	(91)
Nettoabnahme	(7)	(89)
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(3)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse B USD ausschüttend (A)		
Verkauft	–	7
Zurückgekauft	(1)	(7)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	9	61
Zurückgekauft	(17)	(66)
Nettoabnahme	(8)	(5)
Klasse C USD ausschüttend (A)		
Verkauft	1	94
Zurückgekauft	(33)	(154)
Nettoabnahme	(32)	(60)
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	10	16
Zurückgekauft	(9)	(21)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(5)
Klasse E USD ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	50	35
Zurückgekauft	(47)	(38)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(3)
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Verkauft	3	21
Zurückgekauft	(1)	(24)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(3)
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	5
Zurückgekauft	(10)	(7)
Nettoabnahme	(9)	(2)
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	5	–
Zurückgekauft	(3)	(48)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(48)
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse Premier Euro thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(38)
Nettoabnahme	–	(38)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund – (Fortsetzung)		
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	53	8
Zurückgekauft	(1)	(3)
Nettozunahme	52	5
Klasse LM Euro thesaurierend		
Verkauft	2	1
Zurückgekauft	(2)	(4)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	1	3
Zurückgekauft	(3)	(5)
Nettoabnahme	(2)	(2)
Klasse L (G) USD thesaurierend		
Verkauft	–	17
Zurückgekauft	(1)	(17)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse GA USD thesaurierend		
Verkauft	1	1
Zurückgekauft	(1)	(2)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse GA Euro thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(1)	–
Nettozunahme	–	–
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	188	454
Zurückgekauft	(241)	(274)
Netto (abnahme)/-zunahme	(53)	180
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	26	31
Zurückgekauft	(39)	(36)
Nettoabnahme	(13)	(5)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	13	106
Zurückgekauft	(31)	(137)
Nettoabnahme	(18)	(31)
Klasse A Euro thesaurierend		
Verkauft	57	56
Zurückgekauft	(64)	(32)
Netto (abnahme)/-zunahme	(7)	24
Klasse B USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse B USD ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	14	21
Zurückgekauft	(21)	(17)
Netto (abnahme)/-zunahme	(7)	4
Klasse C USD ausschüttend (A)		
Verkauft	10	19
Zurückgekauft	(115)	(13)
Netto (abnahme)/-zunahme	(105)	6
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	48	18
Zurückgekauft	(32)	(31)
Nettozunahme/(-abnahme)	16	(13)
Klasse E USD ausschüttend (A)		
Verkauft	6	–
Zurückgekauft	(10)	(8)
Nettoabnahme	(4)	(8)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	173	362
Zurückgekauft	(145)	(274)
Nettozunahme	28	88
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Verkauft	26	45
Zurückgekauft	(16)	(13)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Nettozunahme	10	32
Klasse U USD thesaurierend		
Verkauft	268	2.650
Zurückgekauft	(1.407)	(3)
Netto (abnahme)/-zunahme	(1.139)	2.647
Klasse U Euro thesaurierend		
Verkauft	157	662
Zurückgekauft	(55)	(4)
Nettozunahme	102	658
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	46	89
Zurückgekauft	(86)	(173)
Nettoabnahme	(40)	(84)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	97	129
Zurückgekauft	(48)	(21)
Nettozunahme	49	108
Klasse X EUR thesaurierend		
Verkauft	19	25
Zurückgekauft	(4)	(1)
Nettozunahme	15	24
Klasse X EUR ausschüttend (A) (mit Absicherung)		
Verkauft	–	10
Zurückgekauft	–	(10)
Nettozunahme	–	–
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	6	1
Zurückgekauft	(2)	–
Nettozunahme	4	1
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	269	1.091
Zurückgekauft	(567)	(1.689)
Nettoabnahme	(298)	(598)
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	16	38
Nettozunahme	16	38
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	233	48
Zurückgekauft	(179)	(70)
Nettozunahme/(-abnahme)	54	(22)
Klasse Premier Euro thesaurierend		
Verkauft	93	1
Zurückgekauft	(4)	–
Nettozunahme	89	1
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Zurückgekauft	(7)	(1)
Nettoabnahme	(6)	–
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	31	606
Zurückgekauft	(135)	(33)
Netto (abnahme)/-zunahme	(104)	573
Klasse LM Euro thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	–	11
Zurückgekauft	(1)	(13)
Nettoabnahme	(1)	(2)
Klasse L (G) USD thesaurierend		
Verkauft	–	28
Zurückgekauft	(1)	(32)
Nettoabnahme	(1)	(4)
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	50	476
Zurückgekauft	(290)	(642)
Nettoabnahme	(240)	(166)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	11	127
Zurückgekauft	(53)	(166)
Nettoabnahme	(42)	(39)
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	20	98
Zurückgekauft	(48)	(146)
Nettoabnahme	(28)	(48)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	2
Zurückgekauft	(2)	–
Nettozunahme	–	2
Klasse A CNH thesaurierend (mit Absicherung)		
Verkauft	–	44
Zurückgekauft	(13)	(6)
Netto (abnahme)/-zunahme	(13)	38
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	107	3
Zurückgekauft	(25)	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	82	(1)
Klasse A Euro thesaurierend		
Verkauft	3	7
Zurückgekauft	(13)	(21)
Nettoabnahme	(10)	(14)
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(4)	(1)
Nettoabnahme	(3)	(1)
Klasse A GBP thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(1)	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse A HKD thesaurierend		
Verkauft	286	566
Zurückgekauft	(281)	(370)
Nettozunahme	5	196
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	2
Zurückgekauft	(1)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(2)
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	54	224
Zurückgekauft	(467)	(357)
Nettoabnahme	(413)	(133)
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	–	3
Zurückgekauft	(1)	(12)
Nettoabnahme	(1)	(9)
Klasse B USD ausschüttend (A)		
Verkauft	2	10
Zurückgekauft	(4)	(11)
Nettoabnahme	(2)	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	1	49
Zurückgekauft	(14)	(58)
Nettoabnahme	(13)	(9)
Klasse C USD ausschüttend (A)		
Verkauft	8	120
Zurückgekauft	(78)	(155)
Nettoabnahme	(70)	(35)
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	4	46
Zurückgekauft	(18)	(84)
Nettoabnahme	(14)	(38)
Klasse E USD ausschüttend (A)		
Verkauft	1	4
Zurückgekauft	(4)	(5)
Nettoabnahme	(3)	(1)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	9	108
Zurückgekauft	(33)	(106)
Netto (abnahme)/-zunahme	(24)	2
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Verkauft	1	5
Zurückgekauft	(1)	(9)
Nettoabnahme	–	(4)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	43	61
Zurückgekauft	(103)	(64)
Nettoabnahme	(60)	(3)
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	10
Zurückgekauft	(30)	(31)
Nettoabnahme	(28)	(21)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	2
Zurückgekauft	(10)	(7)
Nettoabnahme	(8)	(5)
Klasse X EUR thesaurierend		
Verkauft	1	1
Zurückgekauft	(2)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(1)	1
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	15	97
Zurückgekauft	(100)	(244)
Nettoabnahme	(85)	(147)
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	154	111
Zurückgekauft	(190)	(214)
Nettoabnahme	(36)	(103)
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Zurückgekauft	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	5
Zurückgekauft	(1)	(43)
Nettoabnahme	(1)	(38)
Klasse Premier Euro thesaurierend		
Verkauft	3	8
Zurückgekauft	(54)	(17)
Nettoabnahme	(51)	(9)
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(8)
Nettoabnahme	–	(7)
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	15	22
Zurückgekauft	(24)	(12)
Netto (abnahme)/-zunahme	(9)	10
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	17	24
Zurückgekauft	(446)	(13)
Netto (abnahme)/-zunahme	(429)	11
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	61	150
Zurückgekauft	(649)	(263)
Nettoabnahme	(588)	(113)
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	29
Zurückgekauft	(11)	(18)
Netto (abnahme)/-zunahme	(9)	11
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	3	12
Zurückgekauft	(20)	(1)
Netto (abnahme)/-zunahme	(17)	11
Klasse LM Euro thesaurierend		
Verkauft	1	1
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	2	30
Zurückgekauft	(12)	(36)
Nettoabnahme	(10)	(6)
Klasse L (G) USD thesaurierend		
Verkauft	2	42
Zurückgekauft	(4)	(45)
Nettoabnahme	(2)	(3)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	4	67
Zurückgekauft	(6)	(83)
Nettoabnahme	(2)	(16)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	4
Zurückgekauft	(1)	(6)
Nettoabnahme	(1)	(2)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	4	22
Zurückgekauft	(52)	(26)
Nettoabnahme	(48)	(4)
Klasse A USD ausschüttend (Q)		
Verkauft	8	–
Nettozunahme	8	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	7	1
Zurückgekauft	(40)	(5)
Nettoabnahme	(33)	(4)
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Zurückgekauft	(1)	(6)
Nettoabnahme	(1)	(6)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	–
Zurückgekauft	(1)	–
Nettozunahme	1	–
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	54	87
Zurückgekauft	(174)	(190)
Nettoabnahme	(120)	(103)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	55	41
Zurückgekauft	(739)	(12)
Netto (abnahme)/-zunahme	(684)	29
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	6
Zurückgekauft	–	(8)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse C USD ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD ausschüttend (Q)		
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	3	46
Zurückgekauft	(22)	(81)
Nettoabnahme	(19)	(35)
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^		
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	3	–
Zurückgekauft	(3)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	64	51
Zurückgekauft	(47)	–
Nettozunahme	17	51

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	111	598
Zurückgekauft	(363)	(714)
Nettoabnahme	(252)	(116)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	3	29
Zurückgekauft	(22)	(39)
Nettoabnahme	(19)	(10)
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	36	86
Zurückgekauft	(39)	(60)
Netto (abnahme)/-zunahme	(3)	26
Klasse A CNH thesaurierend (mit Absicherung)		
Verkauft	23	64
Zurückgekauft	(6)	(4)
Nettozunahme	17	60
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	114
Zurückgekauft	(36)	(121)
Nettoabnahme	(33)	(7)
Klasse A Euro thesaurierend		
Verkauft	10	36
Zurückgekauft	(33)	(42)
Nettoabnahme	(23)	(6)
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(2)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	(5)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(5)	1
Klasse A GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	1	–
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(4)	(16)
Nettoabnahme	(3)	(16)
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	857	772
Zurückgekauft	(638)	(1.505)
Nettozunahme/(-abnahme)	219	(733)
Klasse A SGD thesaurierend		
Verkauft	27	944
Zurückgekauft	(424)	(1.308)
Nettoabnahme	(397)	(364)
Klasse B USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	1	14
Zurückgekauft	(12)	(19)
Nettoabnahme	(11)	(5)
Klasse C USD ausschüttend (A)		
Verkauft	1	9
Zurückgekauft	(2)	(10)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	5	3
Zurückgekauft	(10)	(9)
Nettoabnahme	(5)	(6)
Klasse E USD ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Zurückgekauft	(1)	(3)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	1
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettozunahme	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund – (Fortsetzung)		
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	2	72
Zurückgekauft	(14)	(52)
Netto (abnahme)/-zunahme	(12)	20
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Verkauft	–	13
Zurückgekauft	(1)	(8)
Netto (abnahme)/-zunahme	(1)	5
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	25	155
Zurückgekauft	(79)	(263)
Nettoabnahme	(54)	(108)
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	8
Zurückgekauft	(3)	(79)
Nettoabnahme	(2)	(71)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	35	53
Zurückgekauft	(100)	(58)
Nettoabnahme	(65)	(5)
Klasse X EUR thesaurierend		
Verkauft	2	84
Zurückgekauft	(5)	(16)
Netto (abnahme)/-zunahme	(3)	68
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	7	46
Zurückgekauft	(43)	(52)
Nettoabnahme	(36)	(6)
Klasse X GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	6
Zurückgekauft	(2)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(2)	6
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	37	997
Zurückgekauft	(692)	(782)
Netto (abnahme)/-zunahme	(655)	215
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	45	50
Zurückgekauft	(99)	(1)
Netto (abnahme)/-zunahme	(54)	49
Klasse Premier Euro thesaurierend		
Verkauft	5	22
Zurückgekauft	(15)	(8)
Netto (abnahme)/-zunahme	(10)	14
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	27	460
Zurückgekauft	(248)	(400)
Netto (abnahme)/-zunahme	(221)	60
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	8	36
Zurückgekauft	(22)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(14)	36
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	23	75
Zurückgekauft	(54)	(288)
Nettoabnahme	(31)	(213)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	6	7
Zurückgekauft	(9)	(15)
Nettoabnahme	(3)	(8)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse A Euro thesaurierend		
Verkauft	1	20
Zurückgekauft	(2)	(17)
Netto (abnahme)/-zunahme	(1)	3
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	–	5
Nettozunahme	–	5

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	1
Zurückgekauft	(1)	(2)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(2)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	11
Zurückgekauft	(4)	(13)
Nettoabnahme	(4)	(2)
Klasse C USD ausschüttend (A)		
Verkauft	–	7
Zurückgekauft	(3)	(10)
Nettoabnahme	(3)	(3)
Klasse E USD thesaurierend		
Verkauft	1	4
Zurückgekauft	(2)	(4)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse E USD ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(1)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	3	10
Zurückgekauft	(6)	(9)
Netto (abnahme)/-zunahme	(3)	1
Klasse R USD thesaurierend		
Zurückgekauft	(3)	(1)
Nettoabnahme	(3)	(1)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	2	3
Zurückgekauft	(6)	(9)
Nettoabnahme	(4)	(6)
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Zurückgekauft	–	(15)
Nettoabnahme	–	(15)
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	3
Zurückgekauft	(30)	(9)
Nettoabnahme	(28)	(6)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	8	–
Zurückgekauft	(9)	(2)
Nettoabnahme	(1)	(2)
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	6
Zurückgekauft	–	(27)
Nettoabnahme	–	(21)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse LM Euro thesaurierend		
Verkauft	2	–
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	(1)	(2)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse L (G) USD thesaurierend		
Verkauft	–	6
Zurückgekauft	–	(6)
Nettozunahme	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	8
Zurückgekauft	(5)	(21)
Nettoabnahme	(4)	(13)
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	(3)	(5)
Nettoabnahme	(3)	(4)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	2
Zurückgekauft	(2)	(2)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A USD ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus		
Verkauft	2	4
Zurückgekauft	(19)	(42)
Nettoabnahme	(17)	(38)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	5	27
Zurückgekauft	(37)	(26)
Netto (abnahme)/-zunahme	(32)	1
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Zurückgekauft	–	(7)
Nettoabnahme	–	(7)
Klasse A Euro thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(1)	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(14)	–
Nettoabnahme	(13)	–
Klasse A EUR ausschüttend (M) Plus		
Zurückgekauft	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	1.720	60
Zurückgekauft	(1.770)	(56)
Netto (abnahme)/-zunahme	(50)	4
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	(1)	(2)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	11
Zurückgekauft	(1)	(16)
Nettoabnahme	(1)	(5)
Klasse C USD ausschüttend (A)		
Verkauft	4	8
Zurückgekauft	(4)	(9)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse E USD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	–
Zurückgekauft	(4)	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	2	1
Zurückgekauft	–	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)
Klasse Premier Euro thesaurierend		
Verkauft	1	5
Zurückgekauft	–	(3)
Nettozunahme	1	2
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	–
Zurückgekauft	(4)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	9	22
Zurückgekauft	(19)	(1)
Netto (abnahme)/-zunahme	(10)	21
Klasse LM Euro thesaurierend		
Verkauft	3	–
Zurückgekauft	(1)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(2)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Zurückgekauft	(1)	(5)
Nettoabnahme	(1)	(3)
Klasse L (G) USD thesaurierend		
Verkauft	–	2
Zurückgekauft	–	(3)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse GA Euro thesaurierend		
Verkauft	8	1
Zurückgekauft	(13)	(5)
Nettoabnahme	(5)	(4)
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	35	11
Zurückgekauft	(12)	(13)
Nettozunahme/(-abnahme)	23	(2)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	46	2
Zurückgekauft	(47)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(2)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	39	114
Zurückgekauft	(42)	(86)
Netto (abnahme)/-zunahme	(3)	28
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	20	57
Zurückgekauft	(47)	(21)
Netto (abnahme)/-zunahme	(27)	36
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	5	16
Nettozunahme	5	16
Klasse A Euro thesaurierend		
Verkauft	2	–
Zurückgekauft	(3)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	99	295
Zurückgekauft	(286)	(334)
Nettoabnahme	(187)	(39)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	13	60
Zurückgekauft	(32)	(45)
Netto (abnahme)/-zunahme	(19)	15
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgekauft	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	6
Zurückgekauft	–	(7)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD ausschüttend (A)		
Verkauft	2	9
Zurückgekauft	(2)	(11)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	4	4
Zurückgekauft	(4)	(4)
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	8
Zurückgekauft	(5)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(5)	8
Klasse S USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	(23)	–
Nettoabnahme	(23)	–
Klasse GA USD thesaurierend		
Verkauft	1	2
Zurückgekauft	(4)	(3)
Nettoabnahme	(3)	(1)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse LM SGD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	26.571
Zurückgekauft	(43)	(8)
Netto (abnahme)/-zunahme	(43)	26.563
Klasse S SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgekauft	–	(27.900)
Nettoabnahme	–	(27.900)
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	2	–
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	4	3
Zurückgekauft	(5)	(9)
Nettoabnahme	(1)	(6)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Zurückgekauft	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	–	19
Zurückgekauft	(13)	(63)
Nettoabnahme	(13)	(44)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	–	8
Zurückgekauft	(30)	(10)
Nettoabnahme	(30)	(2)
Klasse X USD, thesaurierend		
Zurückgekauft	–	(7)
Nettoabnahme	–	(7)
Klasse GA Euro thesaurierend		
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^		
Klasse M GBP ausschüttend (A)		
Verkauft	58	46
Zurückgekauft	(202)	(3)
Netto (abnahme)/-zunahme	(144)	43
Klasse M USD ausschüttend (A)		
Verkauft	28	1
Zurückgekauft	(3)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	25	(1)
Klasse M Euro ausschüttend (A)		
Verkauft	40	35
Nettozunahme	40	35
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	–	88
Nettozunahme	–	88
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	–	319
Nettozunahme	–	319
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^		
Klasse A (PF) USD ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	4	32
Zurückgekauft	(196)	(15)
Netto (abnahme)/-zunahme	(192)	17
Klasse A (PF) EUR thesaurierend		
Verkauft	9	34
Zurückgekauft	(22)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(13)	34
Klasse A (PF) EUR ausschüttend (A)		
Verkauft	2	416
Zurückgekauft	(360)	(158)
Netto (abnahme)/-zunahme	(358)	258
Klasse A (PF) GBP ausschüttend (A) (abgesichert)		
Zurückgekauft	(3)	(2)
Nettoabnahme	(3)	(2)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse J (PF) JPY thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	770
Zurückgekauft	(95)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(94)	770
Klasse M (PF) USD ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	19	2
Zurückgekauft	(143)	(115)
Nettoabnahme	(124)	(113)
Klasse M (PF) Euro thesaurierend		
Verkauft	46	314
Zurückgekauft	(219)	(56)
Netto (abnahme)/-zunahme	(173)	258
Klasse M (PF) Euro ausschüttend (A)		
Verkauft	1.039	1.827
Zurückgekauft	(2.203)	(662)
Netto (abnahme)/-zunahme	(1.164)	1.165
Klasse M (PF) GBP ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	1	41
Zurückgekauft	(222)	(94)
Nettoabnahme	(221)	(53)
Klasse M (PF) NOK ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	–	5
Zurückgekauft	(7)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(7)	5
Klasse M (PF) SEK ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	–	4
Zurückgekauft	(48)	(75)
Nettoabnahme	(48)	(71)
Klasse Premier (PF) USD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	31	9
Zurückgekauft	(6)	(23)
Nettozunahme/(-abnahme)	25	(14)
Klasse Premier (PF) BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	96
Nettozunahme	–	96
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^		
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	2
Zurückgekauft	(9)	(3)
Nettoabnahme	(7)	(1)
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Zurückgekauft	(1)	(1)
Nettozunahme	–	–
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^		
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	2	4
Nettozunahme	2	4
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	16	4
Zurückgekauft	(1)	–
Nettozunahme	15	4
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgekauft	(5)	–
Nettoabnahme	(4)	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse S Euro, thesaurierend		
Verkauft	–	116
Zurückgekauft	–	(26)
Nettozunahme	–	90
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^		
Klasse X EUR thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse S Euro, thesaurierend		
Verkauft	28	–
Nettozunahme	28	–
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^		
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1.389	201
Zurückgekauft	(486)	(326)
Nettozunahme/(-abnahme)	903	(125)
Klasse A USD ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus		
Verkauft	1.796	114
Zurückgekauft	(720)	–
Nettozunahme	1.076	114
Klasse A USD ausschüttend (Q)		
Verkauft	145	47
Zurückgekauft	(109)	(96)
Nettozunahme/(-abnahme)	36	(49)
Klasse A Euro thesaurierend		
Verkauft	2.018	3
Zurückgekauft	(3.434)	(82)
Nettoabnahme	(1.416)	(79)
Klasse A EUR ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	122	–
Zurückgekauft	(66)	–
Nettozunahme	56	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	18	58
Zurückgekauft	(10)	–
Nettozunahme	8	58
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	11	37
Zurückgekauft	(11)	(19)
Nettozunahme	–	18
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	22
Zurückgekauft	–	(10)
Nettozunahme	–	12
Klasse E USD thesaurierend		
Zurückgekauft	(40)	(2)
Nettoabnahme	(40)	(2)
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	68	2
Nettozunahme	68	2
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	90	183
Zurückgekauft	(112)	(125)
Netto (abnahme)/-zunahme	(22)	58
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	45	–
Nettozunahme	45	–
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	1
Zurückgekauft	–	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(4)
Klasse X EUR thesaurierend		
Verkauft	113	–
Nettozunahme	113	–
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Klasse Premier USD thesaurierend		
Verkauft	92	166
Zurückgekauft	(54)	(10)
Nettozunahme	38	156

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2019 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2018 Anteile (in Tsd.)**
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	90	–
Zurückgekauft	(30)	–
Nettozunahme	60	–
Klasse Premier CAD ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)		
Verkauft	144	183
Zurückgekauft	(1.352)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(1.208)	183
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)		
Verkauft	74	74
Zurückgekauft	(92)	–
Netto (abnahme)/-zunahme	(18)	74
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert) (PH)		
Verkauft	1.500	–
Nettozunahme	1.500	–
Klasse Premier Euro thesaurierend		
Verkauft	2.336	1.181
Zurückgekauft	(566)	(857)
Nettozunahme	1.770	324
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	101	103
Zurückgekauft	(130)	(25)
Netto (abnahme)/-zunahme	(29)	78
Klasse Premier GBP ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)		
Verkauft	297	260
Zurückgekauft	(262)	(2.867)
Nettozunahme/(-abnahme)	35	(2.607)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)		
Verkauft	2.338	416
Zurückgekauft	(548)	(2)
Nettozunahme	1.790	414
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	424	–
Nettozunahme	424	–
Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^		
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1

Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 oder auf weniger als 1,000.

Es sind nur Klassen angegeben, bei denen im Berichtszeitraum Transaktionen erfolgt sind.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Erläuterungen zum Abschluss

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

Die bei der Erstellung dieser Jahresabschlüsse angewandten wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze und Schätzverfahren entsprechen denen, die die Gesellschaft in den Jahresabschlüssen für das am 28. Februar 2019 endende Jahr angewendet hat.

Übereinstimmungserklärung

Die Jahresabschlüsse für den am 31. August 2019 endenden Zeitraum sind nach folgenden Standards erstellt worden: nach dem Financial Reporting Standard („FRS") 104: „Interim Financial Reporting", nach den Verordnungen der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) (in der jeweils geltenden Fassung) (die „OGAW-Verordnungen") und nach den Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) (Amendment) Regulations 2019 (die „Central Bank UCITS Regulations"). Der komprimierte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Jahresabschluss für das am 28. Februar 2019 abgeschlossene Geschäftsjahr gelesen werden, der gemäß FRS 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and the Republic of Ireland" erstellt wurde.

Grundlagen

Der Abschluss wurde nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung für die Gesellschaft nach dem Anschaffungskostenprinzip (Historical Cost Convention) erstellt, wobei Finanzanlagen und- verbindlichkeiten über die Ertrags- und Aufwandsrechnung zum Marktwert (Fair Value) ausgewiesen werden. Die Abschlüsse von Legg Mason PCM US Equity Fund^, Legg Mason Congruix Japan Equity Fund^, wurden nach dem Grundsatz der Unternehmensnichtfortführung erstellt, da diese Fonds während der vorherigen Finanzperioden geschlossen wurden. Die Abschlüsse von Legg Mason Martin Currie Japan Absolut-Alpha-Fund^ wurden ebenfalls nach dem Grundsatz der Unternehmensnichtfortführung erstellt, da diese Fonds während der aktuellen Finanzperiode geschlossen wurden.

Das Format und bestimmte Formulierungen des Abschlusses wurden aus dem Companies Act 2014 übernommen und so angepasst, dass sie nach Ansicht des Verwaltungsrats der Art der Geschäftstätigkeit der Gesellschaft als Investmentfonds besser entsprechen.

Die Gesellschaft hat von der Ausnahmeregelung, die offenen Investmentfonds gemäß Abschnitt 7 „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 rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, bereitstellt.

2. Effizientes Portfolio-Management

Vorbehaltlich der Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die gelegentlich von der Central Bank of Ireland (die „Central Bank") festgelegt werden, und sofern die Anlageziele und Anlagepolitik eines Fonds keine abweichende Regelung vorsehen, kann jeder Fonds Investmentmethoden und -instrumente wie Futures, Optionen, Devisenterminkontrakte und sonstige Derivate zum Zweck des effizienten Portfoliomanagements 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 Central Bank eingehalten werden.

Für OGAW, die Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung angewendet haben, sind gemäß den Central Bank UCITS Regulations Offenlegungen erforderlich. OGAW sind verpflichtet, die Erträge aus Wertpapierpensionsgeschäften und umgekehrten Pensionsgeschäften und Wertpapierleihgeschäften für den gesamten Berichtszeitraum zusammen mit den direkten und indirekten Betriebskosten und den angefallenen Gebühren auszuweisen. Siehe dazu die nachstehenden Tabellen.

Einzelheiten zu allen am Ende des Berichtszeitraums offenen Derivaten sind in der Vermögensaufstellung der Fonds aufgeführt. Alle realisierten Gewinne und Verluste aus der Nutzung von Derivatverträgen für ein effizientes Portfoliomanagement sind in den Nettogewinnen/(Verlusten) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert in der Gewinn- und Verlustrechnung enthalten.

Im Laufe des Zeitraums wurden umgekehrte Pensionsgeschäfte für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung abgeschlossen. Einzelheiten zu allen umgekehrten Pensionsgeschäften am Ende des Zeitraums sind in der Vermögensaufstellung aufgeführt.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte

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 2019 mit umgekehrten Pensionsgeschäften erzielten Erträge:

Fondsbezeichnung	31. August 2019 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	USD 27
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	USD 852
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	USD 1
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	USD 4

Bei Käufen und Verkäufen von umgekehrten Pensionsgeschäften sind keine Transaktionskosten angefallen.

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 2019 Wertpapierleihgeschäfte getätigt.

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien

Gemäß gesonderten Anlageverwaltungsverträgen zwischen der Gesellschaft und ClearBridge, LLC und Legg Mason Investments (Europe) Limited („LMI Europe") war jeder Anlageverwalter berechtigt, bis zum 22. März 2019 eine Anlageverwaltungsgebühr aus den Aktiva des entsprechenden Fonds für seine Dienstleistungen als Anlageverwalter zu beziehen (die „Anlageverwaltungsgebühren"). Die Anlageverwaltungsgebühren fielen an jedem Handelstag an und waren monatlich nachträglich fällig.

Am 22. März 2019 wurde die Legg Mason Investments (Ireland) Limited (der „Verwalter") zur Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft ernannt. Gemäß dem Verwaltungsvertrag zwischen der Gesellschaft und dem Verwalter steht dem Verwalter eine Verwaltungsgebühr aus dem Vermögen des jeweiligen Fonds für seine Anlageverwaltungs- und Vertriebsleistungen zu, die an jedem Handelstag aufläuft und jeden Monat rückwirkend gezahlt wird (die „Verwaltungsgebühren"). Die Gesellschaft ist ferner für die umgehende Zahlung bzw. Rückerstattung von Geldern an den Verwalter verantwortlich, die dieser als Provisionen, Übertragungsgebühren, Registrierungsgebühren, Steuern und ähnliche Verbindlichkeiten sowie Kosten und Spesen zu zahlen bzw. ausgelegt hat.

Die maximale Verwaltungsgebühr für jede Anteilsklasse (als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des jeweiligen Fonds, der auf diese Klasse entfällt) ist zum 31. August 2019 wie folgt:

Fondsbezeichnung	Maximale Managementgebühr
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	
Klasse A	0,950 %
Klasse B	1,200 %
Klasse C	1,450 %
Klasse E	1,550 %
Klasse F	0,550 %
Klasse R	0,550 %
Klasse X	0,475 %
Premier-Klasse	0,300 %
Klasse S	0,200 %
Klasse LM	–
Klasse GA	0,820 %
Klasse GE	1,420 %

Fondsbezeichnung	Maximale Managementgebühr
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	
Klasse A	1,150 %
Klasse B	1,400 %
Klasse C	1,650 %
Klasse E	1,750 %
Klasse F	0,550 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,575 %
Premier-Klasse	0,300 %
Klasse LM	–
Klasse A (G)	1,150 %
Klasse B (G)	1,650 %
Klasse L (G)	1,650 %

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

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

Fondsbezeichnung	Maximale Managementgebühr
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
Klasse A	1,000 %
Klasse B	1,250 %
Klasse C	1,500 %
Klasse E	1,600 %
Klasse F	0,550 %
Klasse R	0,600 %
Klasse X	0,500 %
Premier-Klasse	0,300 %
Klasse S	0,200 %
Klasse LM	–
Klasse GA	0,820 %
Klasse GE	1,420 %
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	
Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,850 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,600 %
Premier-Klasse	0,600 %
Klasse S	0,550 %
Klasse LM	–
Klasse A (G)	1,200 %
Klasse B (G)	1,700 %
Klasse L (G)	1,700 %
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	
Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,650 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,550 %
Premier-Klasse	0,400 %
Klasse LM	–
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	
Klasse A	1,150 %
Klasse B	1,400 %
Klasse C	1,650 %
Klasse E	1,750 %
Klasse F	0,700 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,575 %
Premier-Klasse	0,450 %
Klasse LM	–
Klasse A (G)	1,150 %
Klasse L (G)	1,650 %
Klasse GF	0,950 %
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,750 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	0,800 %
Klasse R	1,100 %
Klasse X	0,750 %
Premier-Klasse	0,550 %
Klasse S	0,450 %
Klasse LM	–
Klasse A (G)	1,250 %
Klasse B (G)	1,750 %
Klasse L (G)	1,750 %
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,750 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	0,800 %
Klasse R	1,100 %
Klasse X	0,750 %
Premier-Klasse	0,550 %
Klasse S	0,450 %
Klasse LM	–
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	
Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,500 %
Klasse C	1,750 %
Klasse E	1,850 %
Klasse F	0,700 %
Klasse R	0,850 %
Klasse X	0,625 %
Premier-Klasse	0,450 %
Klasse LM	–
Klasse A (G)	1,250 %
Klasse L (G)	1,750 %

Fondsbezeichnung	Maximale Managementgebühr
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	
Klasse A	0,900 %
Klasse B	1,150 %
Klasse C	1,400 %
Klasse E	1,500 %
Klasse F	0,600 %
Klasse R	0,550 %
Klasse X	0,450 %
Premier-Klasse	0,350 %
Klasse S	0,250 %
Klasse LM	–
Klasse A (G)	1,100 %
Klasse L (G)	1,600 %
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	
Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,850 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,600 %
Premier-Klasse	0,600 %
Klasse LM	–
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
Klasse A	0,850 %
Klasse B	1,100 %
Klasse C	1,350 %
Klasse E	1,450 %
Klasse F	0,600 %
Klasse R	0,450 %
Klasse X	0,425 %
Premier-Klasse	0,350 %
Klasse S	0,250 %
Klasse LM	–
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	
Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,650 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,550 %
Premier-Klasse	0,400 %
Klasse LM	–
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	
Klasse A	1,050 %
Klasse B	1,300 %
Klasse C	1,550 %
Klasse E	1,650 %
Klasse F	0,600 %
Klasse R	0,650 %
Klasse X	0,525 %
Premier-Klasse	0,350 %
Klasse S	0,250 %
Klasse LM	–
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	
Klasse A	1,150 %
Klasse B	1,400 %
Klasse C	1,650 %
Klasse E	1,750 %
Klasse F	0,700 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,575 %
Premier-Klasse	0,450 %
Klasse S	0,350 %
Klasse LM	–
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,750 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,100 %
Klasse X	1,000 %
Klasse Y	1,000 %
Premier-Klasse	1,000 %
Klasse S	0,600 %
Klasse LM	–
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^	
Klasse A	1,200 %
Premier-Klasse	0,500 %
Klasse S	0,400 %
Klasse LM	–

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

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

Fondsbezeichnung	Maximale Managementgebühr
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	
Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,500 %
Klasse C	1,750 %
Klasse E	1,850 %
Klasse F	0,800 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,625 %
Premier-Klasse	0,600 %
Klasse S	0,400 %
Klasse LM	–
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^	
Klasse A	1,200 %
Klasse B	1,450 %
Klasse C	1,700 %
Klasse E	1,950 %
Klasse F	0,700 %
Klasse J	0,400 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,600 %
Premier-Klasse	0,600 %
Klasse S	0,400 %
Klasse LM	–
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^	
Klasse D	1,200 %
Klasse F	1,200 %
Klasse M	0,600 %
Premier-Klasse	0,600 %
Klasse LM	–
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	
Klasse A	1,000 %
Klasse B	1,250 %
Klasse C	1,500 %
Klasse E	1,600 %
Klasse F	0,550 %
Klasse R	0,600 %
Klasse X	0,500 %
Premier-Klasse	0,300 %
Klasse LM	–
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	
Klasse A	0,800 %
Klasse R	0,500 %
Klasse X	0,400 %
Premier-Klasse	0,300 %
Klasse S	0,200 %
Klasse LM	–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	
Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,850 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,600 %
Premier-Klasse	0,600 %
Klasse LM	–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	
Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,600 %
Klasse C	1,850 %
Klasse E	1,950 %
Klasse F	1,100 %
Klasse J	0,900 %
Klasse R	0,950 %
Klasse X	0,900 %
Premier-Klasse	0,900 %
Klasse LM	–
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^	
Klasse A	1,100 %
Klasse F	0,750 %
Klasse X	0,550 %
Premier-Klasse	0,550 %
Klasse S	0,450 %
Klasse LM	–

Fondsbezeichnung	Maximale Managementgebühr
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund^	
Klasse A	1,150 %
Klasse B	1,400 %
Klasse C	1,650 %
Klasse E	1,750 %
Klasse F	0,900 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,650 %
Premier-Klasse	0,650 %
Klasse LM	–
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^	
Klasse A	1,600 %
Klasse B	1,850 %
Klasse C	2,100 %
Klasse E	2,350 %
Klasse F	1,350 %
Klasse R	0,900 %
Klasse X	0,800 %
BW Premier-Klasse	0,350 %
Premier-Klasse	–
BW LM-Klasse	0,800 %
Klasse LM	–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^	
Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,800 %
Klasse J	0,450 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,550 %
Premier-Klasse	0,550 %
Klasse S	0,450 %
Klasse LM	–
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	
Klasse A	1,650 %
Klasse B	1,900 %
Klasse C	2,150 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,300 %
Klasse J	0,750 %
Klasse R	1,250 %
Klasse X	1,150 %
Premier-Klasse	1,150 %
Klasse S	0,750 %
Klasse LM	–
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	
Klasse A	1,050 %
Klasse B	1,300 %
Klasse C	1,550 %
Klasse E	1,650 %
Klasse F	0,700 %
Klasse X	0,525 %
Premier-Klasse	0,525 %
Klasse S	0,400 %
Klasse LM	–
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	
Klasse A	2,000 %
Klasse U	1,000 %
Klasse X	1,150 %
Premier-Klasse	1,150 %
Klasse LM	–
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	
Klasse A	1,200 %
Klasse E	1,950 %
Klasse F	0,950 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,600 %
Premier-Klasse	0,600 %
Klasse S	0,500 %
Klasse LM	–
Legg Mason ClearBridge Value Fund	
Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,850 %
Klasse C	1,850 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	1,100 %
Klasse R	0,850 %
Klasse X	0,675 %
Premier-Klasse	0,675 %
Klasse LM	–
Galleon Klasse	0,850 %

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

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

Fondsbezeichnung	Maximale Managementgebühr
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^	
Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,850 %
Klasse C	1,850 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	1,100 %
Klasse R	0,850 %
Klasse X	0,675 %
Premier-Klasse	0,675 %
Klasse S	0,600 %
Klasse LM	–
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	
Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,750 %
Klasse C	1,750 %
Klasse E	2,000 %
Klasse F	1,000 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,625 %
Premier-Klasse	0,625 %
Klasse LM	–
Klasse A (G)	1,250 %
Klasse B (G)	1,750 %
Klasse L (G)	1,750 %
Klasse GA	1,420 %
Klasse GE	2,170 %
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,750 %
Klasse C	1,750 %
Klasse E	2,000 %
Klasse F	1,000 %
Klasse R	0,750 %
Klasse U	0,525 %
Klasse X	0,625 %
Premier-Klasse	0,625 %
Klasse LM	–
Klasse A (G)	1,250 %
Klasse B (G)	1,750 %
Klasse L (G)	1,750 %
Klasse GA	1,420 %
Klasse GE	2,170 %
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Klasse A	1,300 %
Klasse B	1,800 %
Klasse C	1,800 %
Klasse E	2,050 %
Klasse F	1,050 %
Klasse R	0,800 %
Klasse X	0,650 %
Premier-Klasse	0,650 %
Klasse LM	–
Klasse A (G)	1,300 %
Klasse B (G)	1,800 %
Klasse L (G)	1,800 %
Klasse GA	1,420 %
Klasse GE	2,170 %
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	
Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,750 %
Klasse C	1,750 %
Klasse E	2,000 %
Klasse F	1,000 %
Klasse R	0,800 %
Klasse X	0,625 %
Premier-Klasse	0,625 %
Klasse LM	–
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	
Klasse A	1,200 %
Klasse B	1,700 %
Klasse C	1,700 %
Klasse E	1,950 %
Klasse F	0,950 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,600 %
Premier-Klasse	0,600 %
Klasse S	0,400 %
Klasse LM	–

Fondsbezeichnung	Maximale Managementgebühr
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,750 %
Premier-Klasse	0,750 %
Klasse LM	–
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,750 %
Premier-Klasse	0,750 %
Klasse LM	–
Klasse A (G)	1,250 %
Klasse L (G)	1,750 %
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund	
Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,850 %
Klasse C	1,850 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	1,100 %
Klasse R	0,850 %
Klasse X	0,675 %
Premier-Klasse	0,675 %
Klasse S	0,500 %
Klasse LM	–
Klasse A (G)	1,350 %
Klasse B (G)	1,850 %
Klasse L (G)	1,850 %
Klasse GA	1,420 %
Klasse GE	2,170 %
Klasse GP	0,850 %
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,850 %
Klasse C	1,850 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	1,100 %
Klasse R	0,850 %
Klasse X	0,675 %
Premier-Klasse	0,675 %
Klasse S	0,500 %
Klasse LM	–
Klasse GA	1,620 %
Klasse GE	2,370 %
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	
Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,850 %
Klasse C	1,850 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	1,100 %
Klasse R	0,850 %
Klasse X	0,675 %
Premier-Klasse	0,675 %
Klasse S	0,500 %
Klasse LM	–
Klasse GA	1,420 %
Klasse GE	2,170 %
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse M	1,000 %
Klasse R	1,000 %
Premier-Klasse	0,750 %
Klasse LM	–
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	
Klasse A (PF)	2,000 %
Klasse E (PF)	2,750 %
Klasse F (PF)	1,750 %
Klasse J (PF)	1,000 %
Klasse M (PF)	1,500 %
Klasse R (PF)	1,500 %
Klasse Premier (PF)	1,500 %
Klasse LM	–

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

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

Fondsbezeichnung	Maximale Managementgebühr
Legg Mason Martin Currie Greater China 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	–
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term 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	–
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse J	0,650 %
Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,750 %
Premier-Klasse	0,750 %
Klasse S	0,650 %
Klasse LM	–

Fondsbezeichnung	Maximale Managementgebühr
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	–
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,850 %
Premier-Klasse	0,850 %
Klasse LM	–
Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^	
Klasse A	1,650 %
Klasse B	2,150 %
Klasse C	2,150 %
Klasse E	2,400 %
Klasse F	1,400 %
Klasse R	1,150 %
Klasse X	1,000 %
Premier-Klasse	1,000 %
Klasse S	0,600 %
Klasse LM	–

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

Die in den oben stehenden 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 2019 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.

LMI Europe war bis zum 22. März 2019 für die Zahlung der Gebühren und Ausgaben des jeweiligen Unteranlageverwalters aus seiner eigenen Anlageverwaltungsgebühr verantwortlich. Seit dem 22. März 2019 ist der Verwalter gemäß jedem Anlageverwaltungsvertrag für die Zahlung der Gebühren und Ausgaben des jeweiligen Anlageverwalters verantwortlich.

Bis zum 22. März 2019 hat sich LMI Europe freiwillig bereiterklärt, 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. Seit dem 22. März 2019 hat sich der Verwalter freiwillig bereiterklärt, 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 Berichtszeitraum zum 31. August 2019 wurden die Verwaltungsgebühren wie folgt erlassen und erstattet:

	31. August 2019 in Tsd.	
Fondsbezeichnung	**Investment-management-gebühr nicht in Anspruch genommen**	**Investment-managementgebühr zurückerstattet**
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	USD 3	USD –
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	USD –	USD 1
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	USD 1	USD –
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	USD 31	USD –
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	USD 1	USD 4
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^	USD 19	USD 2
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^	USD 7	USD –
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^	USD 2	USD 16
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	USD –	USD 1
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^	USD 2	USD –
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^	USD 1	USD 4
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	USD 13	USD 4
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	USD 21	USD 2
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	USD 8	USD 13
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^	USD –	USD 9
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	USD 3	USD 1
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	USD 6	USD –
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	USD 1	USD 10
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	USD –	USD 2
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	USD –	USD 9
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	USD 1	USD –
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	USD 1	USD 2
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	EUR 2	EUR 1
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	USD 9	USD –
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	USD 14	USD 9
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	EUR 12	EUR 9
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^	EUR 3	EUR 9
Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^	USD 14	USD 9

Jedem Anlageverwaltungsvertrag zufolge hat jeder Anlageverwalter Anspruch auf eine Anlageverwaltungsgebühr und jeder Anlageverwalter ist dafür verantwortlich, die Gebühren und Spesen von Unteranlageverwaltern aus seiner eigenen Anlageverwaltungsgebühr (die die Performancegebühr umfassen kann) zu zahlen.

Gemäß den Bestimmungen des Hauptvertriebsstellenvertrags zwischen dem Verwalter, der Gesellschaft und Legg Mason Investor Services, LLC („LMIS") ist LMIS ermächtigt, Anteile der Gesellschaft zu vermarkten, zu bewerben, anzubieten und deren Verkauf und Rücknahme zu arrangieren (zusammen als „Vertriebsleistungen" bezeichnet). Darüber hinaus ist LMIS berechtigt, auf eigene Kosten und Aufwendungen eine oder mehrere Vertriebsstellen zu beauftragen, die sie bei der Erfüllung von Aufgaben und Verantwortlichkeiten unterstützen, sofern die Ernennungen dieser anderen Unternehmen gemäß den Anforderungen der Central Bank Rules erfolgen. Gemäß den Bedingungen des Hauptvertriebsstellenvertrags zwischen dem Verwalter, der Gesellschaft und LMIS bleibt LMIS in diesen Fällen de Verwalter für die Erfüllung ihrer Verpflichtungen aus diesem Vertrag verantwortlich. Dementsprechend hat LMIS LMI Europe als zusätzliche Vertriebsstelle der Fonds ernannt. Ebenso ist LMI Europe gemäß den Bedingungen des Vertriebsvertrags mit LMIS auf eigene Kosten und Aufwendungen befugt, einen oder mehrere Vertriebsstellen zu beauftragen, die sie bei der Erfüllung von Aufgaben und Verantwortlichkeiten unterstützen, sofern die Ernennungen dieser anderen Unternehmen gemäß den Anforderungen der Central Bank Rules erfolgen. Gemäß den Bedingungen des Vertriebsertrags zwischen LMIS und LMI Europe bleibt LMI Europe in diesen Fällen LMIS für die Erfüllung ihrer Verpflichtungen aus diesem Vertrag verantwortlich. LMI Europe Limited hat gemäß dem Vertriebsvertrag mit LMIS und im Einklang mit den Anforderungen der Central Bank Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited, Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited und Legg Mason Investments (Taiwan) Limited als zusätzliche Vertriebsstellen der Fonds bestellt.

LMI Europe erbringt Fondsregistrierungs- und Fondsführungsleistungen für die Gesellschaft.

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

Informationsstellengebühr

Die Gesellschaft hat LMIS zur Hauptinformationsstelle der Gesellschaft bestellt. Gemäß den Bestimmungen des Hauptinformationsstellenvertrags wurde LMIS ermächtigt, auf ihre eigenen Kosten und Aufwendungen eine oder mehrere Parteien zu bestellen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, wobei LMIS der Gesellschaft gegenüber weiterhin für die Erfüllung ihrer Verpflichtungen aus diesem Vertrag haftete. In diesem Rahmen hat LMIS die LMI Europe als zusätzliche Informationsstelle bestellt. In gleicher Weise wurde LMI Europe gemäß den Bestimmungen des Informationsstellenvertrags mit LMIS ermächtigt, auf ihre eigenen Kosten und Aufwendungen eine oder mehrere Parteien zu bestellen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, wobei LMI Europe der Gesellschaft und LMIS gegenüber weiterhin für die Erfüllung ihrer Verpflichtungen aus diesem Vertrag haftete. In diesem Rahmen hat LMI Europe die Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited, die Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited und die Legg Mason Investments (Taiwan) Limited zu Informationsstellen der Gesellschaft bestellt. Der Gesamtbetrag der von der Gesellschaft gezahlten Informationsstellengebühren entspricht:

(i) 0,15 Prozent p.a. des Nettoinventarwerts des Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund, des Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund, des Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, des Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund, des Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund, des Legg Mason Western Asset US High Yield Fund, des Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, des Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, des Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund, des Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund, des Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund, des Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund, des Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, des Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^, des Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^, des Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, des Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^, des Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^, des Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^, des Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^, des Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^, des Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^, des Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^, des Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund, des Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^, des Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^, des Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund^, des Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^, des Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^, des Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^, des Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^, und des 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^, des Legg Mason ClearBridge Value Fund, des Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^, des Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund, des Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund, des Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund, des Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, des Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^, des Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund, des Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund, des Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund, des Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, des Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund, des Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^, des Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^, des Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^, des Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^, des Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^, des Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^, des Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^ und des Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

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

Die Informationsstellengebühren müssen für alle Anteilsklassen bezahlt werden, außer für die Anteilsklassen F, J, U, Y, Premier, LM, Grandfathered und Galleon (jeweils gemäß Definition im Verkaufsprospekt) sowie alle Anteilsklassen.

Im Berichtszeitraum zum 31. August 2019 wurden die Informationsstellengebühren wie folgt erlassen:

Fondsbezeichnung	Informationsstellengebühr nicht in Anspruch genommen 31. August 2019 (in Tsd.)	
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	USD	12
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	USD	10
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	USD	3
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	USD	4
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^	USD	1
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^	USD	3
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^	USD	1
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	USD	8
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	USD	2
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	USD	2
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund	EUR	6
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	USD	8
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	USD	9
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	USD	270
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	EUR	92
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^	USD	21
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	USD	1
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	EUR	2
Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^	USD	2

Verbundene Parteien

Joseph LaRocque (bis 1. Juli 2019), Jane Trust und Joseph Carrier waren bzw. sind Mitglieder des Verwaltungsrats der Gesellschaft und waren bzw. sind auch Verwaltungsratsmitglieder und/oder Führungskräfte bestimmter Tochtergesellschaften des Verwalters, des Anlageverwalters, der Vertriebsstellen und der Informationsstellen. Mit Ausnahme der oben genannten Fälle hat keines der Verwaltungsratsmitglieder eine direkte oder indirekte Beteiligung an einem Vertrag oder einer Vereinbarung, die zum Zeitpunkt dieses Vertrags besteht und die für die Geschäftstätigkeit der Gesellschaft von Bedeutung ist.

Zum 31. August 2019 hielten die Fonds in der nachfolgenden Tabelle Anlagen in Investmentfonds, welche denselben Verwalter, Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter wie der Fonds oder eine verbundene Partei dieses Verwalters, Anlageverwalters oder Unteranlageverwalters bestellt haben.

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

Fonds	Zugrunde liegender Investmentfonds	31. August 2019 %		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)	0,93 %	USD	16.915
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse M	7,02 %	USD	9.699
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	EUR	346
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse M	8,80 %	USD	12.171
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Legg Mason Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD thesaurierend	14,33 %	USD	9.108
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,39 %	USD	7.075
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	USD	605
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse M	8,80 %	USD	12.160
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Legg Mason Western Asset Asian Bond Trust – Klasse A (SGD), thesaurierend	24,57 %	USD	6.053
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,26 %	USD	4.666
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,93 %	USD	16.866
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse M	5,54 %	USD	7.658
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Legg Mason Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD thesaurierend	8,17 %	USD	5.195
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,62 %	USD	11.265

Fonds	Zugrunde liegender Investmentfonds	31. August 2019 %		wert (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,20 %	USD	3.686
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,00 %	EUR	29
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse M	18,50 %	USD	25.574
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Legg Mason Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD thesaurierend	1,74 %	USD	1.107
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,07 %	USD	1.281
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	7,67 %	USD	139.042
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	3,30 %	USD	59.826
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,07 %	USD	1.233
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,39 %	USD	7.155
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,06 %	USD	1.017

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

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

Gegenseitige Anlagen durch die Fonds innerhalb der Gesellschaft werden in Erläuterung 13 zum Jahresabschluss offengelegt.

Transaktionen mit verbundenen Personen

In Regulation 43(1) der Central Bank UCITS Regulations heißt es, dass eine „verantwortliche Person dafür Sorge trägt, dass jede Transaktion zwischen einem OGAW und einer verbundenen Person (a) zu marktüblichen Bedingungen; und (b) im besten Interesse der Inhaber des OGAW durchgeführt wird".

Gemäß den Anforderungen von Regulation 81(4) der Central Bank UCITS Regulations 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 Geschäftsjahres eingegangen wurden, den durch die Verordnung 43(1) vorgeschriebenen Verpflichtungen gerecht wurden.

Erfolgsprämie

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

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^

Beim Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ und beim (bis zum 31. Mai 2019, als der Fonds den Handel einstellte) wird (bzw. wurde) die Performancegebühr für jede Anteilsklasse PF in der Regel in Bezug auf jeden zwölfmonatigen Zeitraum, der am letzten Handelstag jedes Geschäftsjahres endet, berechnet („Berechnungszeitraum"). Für jede Anteilsklasse PF ist der erste Berechnungszeitraum der Zeitraum, der an dem Geschäftstag beginnt, der unmittelbar auf den Börsentag folgt, an dem der Nettoinventarwert für die Anteilsklasse erstmals berechnet wird (der „Erste Handelstag"), und der am letzten Handelstag des Geschäftsjahrs endet, in dem der erste Handelstag eintritt (der „Erste Berechnungszeitraum").

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

Die High Water Mark in Bezug auf jede Anteilsklasse PF des Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ und des ist (bzw. war) der höhere der folgenden Beträge: (i) Erstausgabepreis je Anteil; (ii) höchster Nettoinventarwert je Anteil unmittelbar nach dem Ende eines vorausgehenden Berechnungszeitraums; und (iii) wenn die Anteilsklasse PF über eine Einbringung einer Anteilklasse in einen anderen vom Unteranlageverwalter verwalteten Fonds erfolgt, die High-Water-Mark für diese Anteilsklasse am Datum der Einbringung entsprechend der Berechnung des relevanten Angebotsdokuments für diesen anderen Fonds.

Der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ und der (bis zum 31. Mai 2019, als der Fonds den Handel einstellte) führten keine Ausgleichskonten für Anteilsinhaber in Bezug auf die aufgelaufenen Performancegebühren.

Die im Berichtszeitraum zum 31. August 2019 berechneten Erfolgsprämien werden in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesen.

Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren

BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited fungiert als Verwahrstelle und BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company fungiert als Verwaltungsstelle für alle Fonds der Gesellschaft. Sie erhalten für Verwaltungs-, Rechnungslegungs-, Informationsstellen-, Treuhänder- und Verwahrstellendienste von den Fonds insgesamt eine Gebühr von bis zu 0,15 % des Nettoinventarwerts jedes Fonds.

Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrats

Die Vergütung und Ausgaben der Verwaltungsratsmitglieder, aus Gewinn und Verlust in der Gesamtergebnisrechnung entstanden sind und für den Berichtszeitraum zum 31. August 2019 gelten, beliefen sich auf 124.000 US-Dollar. Die Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder ist nicht für Jane Trust und Joseph Carrier zu zahlen, die Mitarbeiter des Verwalters, des Anlageverwalters oder seiner Tochtergesellschaften sind. Die Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder für Joseph LaRocque, der bis zum 30. Juni 2019 Mitarbeiter des Verwalters, des Anlageverwalters oder seiner Tochtergesellschaften war, ist ab 1. Juli 2019 zu entrichten.

Sonstige Transaktionen mit nahe stehenden Parteien

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

Fondsbezeichnung	% Beteiligung 31. August 2019
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	97,12
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	26,04
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	24,35
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	21,05
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	24,02
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	30,17
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	21,62
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	20,03
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	26,70
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	76,20
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	82,64
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	49,55
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	93,52
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	24,19
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	20,47
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^	68,28
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^	25,05
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	68,20
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^	83,30
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^	34,46
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	99,87
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	75,30
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	59,15
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	37,62
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^	57,67
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	30,79
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^	28,50
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	26,71
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	23,65
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	20,20
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	99,89
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	95,26
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	41,12
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	36,29
Legg Mason ClearBridge Value Fund	24,49
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^	86,73
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	31,70
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	24,44
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	46,42
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund	50,39
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	96,44

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

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

Fondsbezeichnung	% Beteiligung 31. August 2019
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	32,62
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	26,81
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	24,83
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	22,72
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	21,24
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^	81,79
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	54,74
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	36,45
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund^	21,08
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	50,98
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	48,65
Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^	99,35

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 Dividendenfestsetzungen	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 der Dividendenerklärung: (1) Etwaige Nettoanlageerträge 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 (Aktienfonds wie auf Seite 15 definiert) wird zum Zeitpunkt der Dividendenerklärung der gesamte oder ein Teil eines etwaigen Nettoanlageertrags als Dividende erklärt. Sofern der Anteilsinhaber nichts anderes verlangt, erfolgen die Ausschüttungen an jeden Anteilsinhaber der einzelnen ausschüttenden Anteilsklassen in der Währung, in der der Anteilsinhaber die Anteile gezeichnet hat.

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

Die ausschüttenden Anteilsklassen „Plus" können Ausschüttungen aus dem Kapital deklarieren und auszahlen. Die Anleger dieser Anteilsklassen sollten sich bewusst sein, dass die Ausschüttung von Dividenden aus dem Kapital eine Rendite oder Rücknahme eines Teils der ursprünglichen Investition eines Anlegers oder von Kapitalgewinnen bedeutet, die dieser ursprünglichen Investition zuzuschreiben sind. Und solche Ausschüttungen führen zu einem entsprechenden sofortigen Rückgang des Nettoinventarwerts pro Anteil der Anteilsklasse. Die Auszahlung von Ausschüttungen aus dem Kapital führt demnach zu Kapitalerosion und kann durch Verzicht auf das Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erreicht werden.

Im Berichtszeitraum haben die folgenden Fonds Ausschüttungen aus dem Kapital auf ausschüttende Anteilsklassen Plus vorgenommen:

Fondsbezeichnung	Ausschüttungen aus dem Kapital für den Berichtszeitraum zum 31. August 2019 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	USD 13
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 22
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	USD 9
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD –
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	USD 5
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	USD 10
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 1
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	USD 1
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 9
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 63
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	USD 6
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 3
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	USD –
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 1
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	USD 36
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 86
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 20
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	USD 423
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 175
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 103
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	USD 151
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 12
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	USD 4
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	USD –
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ – Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	USD 10
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ – Klasse D AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD –
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	USD –
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 4
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	USD –
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 2
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	USD 81
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 34
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 2
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	USD 38
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 3
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	EUR 39
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	EUR 10
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	EUR 1
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	EUR –
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	EUR 1
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	USD 87
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 36
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 2
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	USD 28
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 1
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	USD 2
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD 1

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

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

Fondsbezeichnung	Ausschüttungen aus dem Kapital für den Berichtszeitraum zum 31. August 2019 (in Tsd.)	
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	USD	1
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	USD	–
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^ – Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	EUR	126
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^ – Klasse A EUR ausschüttend (M) Plus	EUR	2
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^ – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	EUR	5

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

Die ausschüttenden Anteilsklassen Plus (e) und Plus (u), die von bestimmten Fonds angeboten wurden, können bestimmte Gebühren und Ausgaben dem Kapital anstatt den Erträgen berechnen. Die Berechnung der gesamten Gebühren und Ausgaben auf das Kapital führt dazu, dass die Erträge für die Ausschüttung erhöht werden. Das Kapital, das diesen ausschüttenden Anteilsklassen Plus (e) und Plus (u) für künftige Investitionen zur Verfügung steht, und das Kapitalwachstum können jedoch verringert werden. Die Anteilsinhaber sollten beachten, dass ein erhöhtes Risiko besteht, dass die Aktionäre bei der Rücknahme von Anteilen der ausschüttenden Anteilklassen Plus (e) und Plus (u) möglicherweise nicht den gesamten investierten Betrag zurückerhalten. Für Anleger in die ausschüttenden Anteilsklassen Plus (e) und Plus (u) kann dies zu einer Erosion der Kapitalanlage der Anleger unabhängig von der Performance des entsprechenden Fonds oder der Kapitalgewinne, die auf diese ursprüngliche Investition zurückzuführen sind, führen, was den Wert zukünftiger Renditen wahrscheinlich mindern wird. Die erhöhte Dividendenausschüttung infolge der Anrechnung von Gebühren und Ausgaben auf das Kapital führt effektiv zu einer Rendite oder Rücknahme der ursprünglichen Kapitalanlage eines Investors oder von Kapitalgewinnen, die auf diese ursprüngliche Anlage zurückzuführen sind. Die höhere Dividendenausschüttung im Rahmen dieses Abrechnungsmechanismus führt zu einem entsprechenden sofortigen Rückgang des Nettoinventarwerts der Anteilsklassen zum Ex-Tag. Die Anteilsinhaber sollten beachten, dass in dem Umfang, in dem die Ausgaben dem Kapital belastet werden, einige oder alle Ausschüttungen der ausschüttenden Anteilsklassen Plus (e) und Plus (u) als eine Form der Kapitalerstattungen angesehen 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 Ausgaben vom Kapital abgezogen:

Fondsbezeichnung	Dem Kapital berechnete Gebühren und Aufwendungen im Berichtszeitraum zum 31. August 2019 (in Tsd.)	
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A Euro, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	3
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	4
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	–
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	26
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	15
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Klasse S Euro, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	3
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	243
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	3.336
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	268
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	36
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	192
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	522
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	–
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	–
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	444
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	53
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	108
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	1.858
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	–
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ – Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	–
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ – Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	–
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	–
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ – Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	–
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ – Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	–
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ – Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	124
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	1
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^ – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	–
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^ – Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	129
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Klasse A Euro, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	93
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	5
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	2
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	15
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	7
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	2
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	7
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	1
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	10
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	9
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	–
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ – Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	–
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	1
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A Euro, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	3
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	–
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	USD	–
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	USD	–
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^ – Klasse Premier GBPm, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	EUR	–
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^ – Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	EUR	241
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^ – Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)	EUR	136

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

Thesaurierende Anteilsklassen

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

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

5. Grundkapital und rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile

Grundkapital

Die Gesellschaft wurde mit einem anfänglichen Grundkapital in Höhe von 39,000 Euro (in Form von 39,000 Zeichneranteilen ohne Nennwert) gegründet. Bis auf drei hat die Gesellschaft alle Zeichneranteile zurückgekauft. Die Inhaber dieser drei Zeichneranteile sind berechtigt, an allen Versammlungen der Gesellschaft teilzunehmen und dort abzustimmen, sie sind jedoch nicht berechtigt, an den Dividenden bzw. dem Nettovermögen eines Fonds oder der Gesellschaft zu partizipieren.

Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile

Das Grundkapital der Gesellschaft entspricht zu jeder Zeit dem Nettoinventarwert. Die Mitglieder des Verwaltungsrats sind ermächtigt, bis zu 500 Milliarden Anteile der Gesellschaft ohne Nennwert zum Nettoinventarwert je Anteil und zu den ihnen angemessen erscheinenden Bedingungen auszugeben. Bei der Emission von Anteilen an der Gesellschaft besteht kein Vorkaufsrecht.

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

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

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

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, wie in Erläuterung 4, Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen, oben erklärt. Darüber hinaus befinden sich Zeichneranteile der Gesellschaft in Umlauf, deren Inhaber jedoch keinen Anspruch auf eine Beteiligung am Vermögen eines Fonds haben.

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 betreffende Anlagemanager und 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 stehen allen Anlegern zur Verfügung. Provisions-/Rabattzahlungen können von Vertriebsstellen an Händler oder andere Anleger geleistet werden, die eine Vereinbarung mit einer Vertriebsstelle bezüglich dieser Anteile haben. Anteile der Klassen B, C, D und E stehen allen Anlegern zur Verfügung, die Kunden von Händlern sind, die von einer Vertriebsstelle in Bezug auf solche Anteile ernannt werden. Provisionszahlungen können von Vertriebsstellen an Händler oder andere Anleger geleistet werden, die eine Vereinbarung mit einer Vertriebsstelle bezüglich dieser Anteile haben. Anteile der Klasse F stehen professionellen Anlegern und Anlegern mit einem Vermögensverwaltungsvertrag mit einem Händler zur Verfügung, der von der Vertriebsstelle in Bezug auf diese Anteile bestellt wurde. Provisions-/Rabattzahlungen können von Vertriebsstellen an Händler oder andere Anleger geleistet werden, die eine Vereinbarung mit der Vertriebsstelle bezüglich dieser Anteile haben. Die Aktien der Klasse J sind nach Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebsstellen für den japanischen Vertrieb bestimmt. Anteile der Klasse M stehen professionellen Anlegern und Anlegern mit einem Vermögensverwaltungsvertrag mit einem Händler oder einem anderen Unternehmen zur Verfügung, der bzw. das von der Vertriebsstelle in Bezug auf diese Anteile bestellt wurde. Anteile der Klasse R stehen allen Anlegern zur Verfügung, 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 stehen Händlern, Portfolioverwaltern oder Plattformen zur Verfügung, die gemäß behördlichen Auflagen oder auf der Grundlage von Gebührenvereinbarungen mit ihren Kunden keine Provisionen annehmen und behalten dürfen, sowie institutionellen Anlegern (für Anleger in der Europäischen Union bedeutet dies „geeignete Gegenparteien" gemäß MIFID II), die auf eigene Rechnung investieren. Anteile der Klassen U, Y und S stehen institutionellen Anlegern nach Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebsstellen zur Verfügung. Die Anteilsklassen BW LM stehen nach Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebsstellen qualifizierten Anlegern zur Verfügung, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe oder Kunden solcher Mitglieder sind. Die Anteilsklassen LM stehen nach Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebsstellen qualifizierten Anlegern zur Verfügung, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe, von Altersvorsorgeprogrammen und ähnlichen Systemen sind, die von Mitgliedern der Legg Mason-Gruppe oder Kunden solcher Mitglieder gesponsert werden. Für Anleger mit Sitz in der Europäischen Union stehen die Anteilsklassen BW Premier nach Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebsstellen „geeigneten Gegenparteien" gemäß MIFID II zur Verfügung. Für Anleger außerhalb der Europäischen Union stehen die Anteilsklassen BW Premier nach Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebsstellen institutionellen Anlegern oder qualifizierten Anlegern zur Verfügung, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe oder Kunden solcher Mitglieder sind. Für Anleger mit Sitz in der Europäischen Union stehen die Anteilsklassen Premier „geeigneten Gegenparteien" gemäß MIFID II zur Verfügung; für Anleger mit Sitz außerhalb der Europäischen Union stehen die Anteilsklassen Premier institutionellen Anlegern zur Verfügung.

Bei Anteilsklassen, die den Begriff „(abgesichert)" in ihrem Namen nach der Währungsbezeichnung enthalten, ist vorgesehen, dass solche Anteilsklassen gegen Wechselkursschwankungen zwischen der Währung der Anteilsklasse und der Basiswährung des jeweiligen Fonds abgesichert werden. Bestimmte Aktienklassen in Fonds, die von Brandywine Global Investment Management, LLC verwaltet werden, werden im Verhältnis zu einem Index abgesichert, was durch die Aufnahme eines „(IH)" in den Namen der Anteilsklasse angezeigt wird. Der von RARE Infrastructure Limited verwaltete Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund bietet Portfolio-gesicherte Anteilsklassen, wie durch die Aufnahme eines „(PH)" in den Namen der Anteilsklasse angezeigt wird. Bestimmte Fonds bieten Anteilsklassen an, die eine Erfolgsprämie zahlen können, wie im Namen der Anteilsklasse durch „(PF)" angegeben.

Bestimmte Fonds haben auch Anteile der Anteilsklassen Grandfathered ausgegeben, die durch die Aufnahme von „GA", „GE", „GP" oder „(G)" in den Namen der Anteilsklasse gekennzeichnet sind. Die Grandfathered-Anteilsklassen stehen nur den Anteilsinhabern der angeschlossenen Fonds zur Verfügung. Anteile der Grandfathered-Klassen werden für weitere Zeichnungen durch Anteilsinhaber der jeweiligen Anteilsklasse und 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 des Vorstehenden, wie in den Fondsergänzungen angegeben, können bestimmte Grandfathered-Anteilsklassen für bestimmte Fonds von bestehenden Anteilsinhabern in der Anteilsklasse nach alleinigem Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder für weitere Zeichnungen zur Verfügung gestellt werden.

Darüber hinaus werden keine Anteile der Klasse Galleon des Legg Mason ClearBridge Value Fund mehr zur Zeichnung angeboten, die sich durch die Mindestzeichnungsbeträge, Ausgabeaufschläge oder Gebührensätze von anderen Anteilsklassen unterscheiden.

6. Besteuerung

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

Die Gesellschaft ist in Irland bei Eintritt eines zu besteuernden Ereignisses in Bezug auf Folgendes 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) bestimmte steuerbefreite Anteilsinhaber mit Steuersitz in Irland, die der Gesellschaft die gesetzlich vorgeschriebenen unterzeichneten 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. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

Die Barguthaben der einzelnen Fonds werden bei der BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited und den einzelnen Sub-Depotbanken geführt. Barmittel und andere liquide Mittel werden zum Nennwert und gegebenenfalls unter Berücksichtigung aufgelaufener Zinsen bewertet. „Margenkonten und eingeschränkte liquide Mittel" in der Bilanz stellen Margeneinlagen, Barsicherheiten und realisierte Gewinne und Verluste aus noch nicht gelieferten Terminkontrakten dar.

8. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 31. August 2019 bestanden keine wesentlichen Verpflichtungen oder Eventualverbindlichkeiten.

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

9. Soft-Commission-Vereinbarungen

Die Gesellschaft hat Richtlinien entwickelt, mit denen gewährleistet werden soll, dass ihre Dienstleister im besten Interesse der Fonds handeln, wenn sie Handelsentscheidungen für Rechnung 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 Anteilinhaber auf Anfrage kostenlos erhältlich.

Im Berichtszeitraum zum 31. August 2019 hat Royce & Associates, LP („Royce") mit Maklern Soft-Commission-Vereinbarungen getroffen, jedoch die entsprechenden Fonds für die im Rahmen dieser Vereinbarungen entstandenen Forschungskosten erstattet.

10. Wechselkurse

In diesem Abschluss wurden für die jeweiligen auf US-Dollar, Euro, britische Pfund un japanische Yen lautenden Fonds die Beträge in Fremdwährungen anhand folgender Wechselkurse in US-Dollar, Euro, britische Pfund un japanische Yen umgerechnet:

	Währung	Wechselkurse per 31. August 2019
Auf USD lautende Fonds	Argentinischer Peso	59,5088
	Australischer Dollar	1,4849
	Brasilianischer Real	4,1410
	Britisches Pfund	0,8218
	Kanadischer Dollar	1,3314
	Chilenischer Peso	721,6000
	Chinesischer Renminbi (CNH)	7,1600
	Chinesischer Renminbi (CNY)	7,1453
	Kolumbianische Peso	3.442,6500
	Tschechische Krone	23,6068
	Dänische Krone	6,7846
	Ägyptisches Pfund	16,5500
	Euro	0,9099
	Ghanaischer Cedi	5,4750
	Hongkong-Dollar	7,8404
	Ungarischer Forint	301,3922
	Indische Rupie	71,4075
	Indonesische Rupiah	14.185,0000
	Israelischer Schekel	3,5343
	Japanischer Yen	106,2350
	Malaysischer Ringgit	4,2055
	Mexikanischer Peso	20,0415
	Neuseeländischer Dollar	1,5871
	Nigerianischer Naira	362,9200
	Norwegische Krone	9,1122
	Pakistanische Rupie	156,4000
	Peruanischer Nuevo Sol	3,3936
	Philippinischer Peso	52,0575
	Polnischer Zloty	3,9809
	Rumänischer Leu	4,3008
	Russischer Rubel	66,7100
	Singapur-Dollar	1,3878
	Südafrikanischer Rand	15,1688
	Südkoreanischer Won	1.211,2500
	Schwedische Krone	9,8147
	Schweizer Franke	0,9898
	Taiwan-Dollar	31,4100
	Thailändischer Baht	30,5725
	Türkische Lira	5,8265
	Ukrainische Hrywnja	25,1250
	Dirham (Vereinigte Arabische Emirate)	3,6732
	Uruguayischer Peso	36,6000

	Währung	Wechselkurse per 31. August 2019
Auf EUR lautende Fonds	Australischer Dollar	1,6320
	Brasilianischer Real	4,5512
	Britisches Pfund	0,9032
	Kanadischer Dollar	1,4633
	Chinesischer Renminbi (CNY)	7,8530
	Dänische Krone	7,4566
	Hongkong-Dollar	8,6170
	Ungarischer Forint	331,2453
	Mexikanischer Peso	22,0266
	Norwegische Krone	10,0148
	Polnischer Zloty	4,3751
	Südafrikanischer Rand	16,6712
	Schwedische Krone	10,7868
	Schweizer Franke	1,0878
	Türkische Lira	6,4036
	US-Dollar	1,0991

	Währung	Wechselkurse per 31. August 2019
Auf GBP lautende Fonds	Euro	1,1071
	Schwedische Krone	11,9425
	US-Dollar	1,2168

	Währung	Wechselkurse per 31. August 2019
Auf JPY lautende Fonds	US-Dollar	0,0094

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Die Gesellschaft hat Messungen des beizulegenden Zeitwerts anhand einer Marktwerthierarchie klassifiziert, die die Bedeutung der bei der Durchführung der Messungen verwendeten Eingaben widerspiegelt. Die Marktwerthierarchie kennt folgende Stufen:

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

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

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

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

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

Die folgenden Tabellen schlüsseln per 31. Augustr 2019 die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten gemäß den Bewertungsstufen auf:

	Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	**Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)**	**Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)**	**Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)**
Stufe 1				
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	EUR –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	57	–	244
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	611	6.907	267	1
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(169)	(6.576)	(1.077)	(1)
	442	**388**	**(810)**	**244**
Stufe 2				
Anleihen und Schuldtitel	USD 186.886	USD 1.355.136	EUR 120.668	USD 19.529
Geldmarktinstrumente	–	89.400	–	401
Eigenkapitalinstrumente	16.915	9.699	346	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1.123	13.689	11	4
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(3.596)	(31.205)	(302)	(18)
	201.328	**1.436.719**	**120.723**	**19.916**
Stufe 3				
Anleihen und Schuldtitel	USD 2.052	USD 11.758	EUR –	USD 287
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–
	2.052	**11.758**	**–**	**287**
Anlagen insgesamt	**USD 203.822**	**USD 1.448.865**	**EUR 119.913**	**USD 20.447**

	Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	**Legg Mason Western Asset US High Yield Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)**	**Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)**	**Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)**	**Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)**
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	375	2.576	–	–	682
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	164	5	–	–	250
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(1.762)	(12)	(9)	(10)	–
	(1.223)	**2.569**	**(9)**	**(10)**	**932**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	USD 552.852	USD 149.315	USD 17.882	USD 36.192	USD 90.911
Geldmarktinstrumente	13.047	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	63.785	7.075	2.145	–	6.783
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	2.086	–	113	107	117
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(3.982)	(43)	(132)	(49)	(328)
	627.788	**156.347**	**20.008**	**36.250**	**97.483**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	USD 4	USD 793	USD –	USD –	USD 636
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	37	117	–	–	134
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	41	**910**	**–**	**–**	**770**
Anlagen insgesamt	**USD 626.606**	**USD 159.826**	**USD 19.999**	**USD 36.240**	**USD 99.185**

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)
Stufe 1				
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	113	2.182	1	1.170
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(457)	–	(1.280)	(2.688)
	(344)	**2.182**	**(1.279)**	**(1.518)**
Stufe 2				
Anleihen und Schuldtitel	USD 34.630	USD 477.825	USD 184.316	USD 247.329
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	605	22.879	16.866	24.118
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	189	658	1.277	1.565
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(67)	(1.281)	(630)	(1.763)
	35.357	**500.081**	**201.829**	**271.249**
Stufe 3				
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD 821
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**821**
Anlagen insgesamt	**USD 35.013**	**USD 502.263**	**USD 200.550**	**USD 270.552**

	Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	USD –	EUR –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	5.617	–	243
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	43	–	108.806	4	2.119
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(106)	–	(467.229)	–	(1.158)
	(63)	**–**	**(352.806)**	**4**	**1.204**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	USD 72.834	EUR 60.135	USD 5.998.132	USD 31.013	USD 717.518
Geldmarktinstrumente	–	2.884	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	3.686	29	25.574	–	7.291
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	495	259	294.414	698	5.363
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(698)	(399)	(855.732)	(514)	(13.661)
	76.317	**62.908**	**5.462.388**	**31.197**	**716.511**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	USD –	EUR –	USD –	USD –	USD 2.143
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**2.143**
Anlagen insgesamt	**USD 76.254**	**EUR 62.908**	**USD 5.109.582**	**USD 31.201**	**USD 719.858**

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)
Stufe 1				
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	247	3.712	258	31
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(711)	(2.921)	(479)	(2)
	(464)	**791**	**(221)**	**29**
Stufe 2				
Anleihen und Schuldtitel	USD 48.902	USD 1.375.434	USD 941.658	USD 109.486
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	2.388	139.042	59.826	1.233
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	330	1.501	–	6
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(141)	(11.197)	(22)	(69)
	51.479	**1.504.780**	**1.001.462**	**110.656**
Stufe 3				
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD 37.910	USD 3.881	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–
	–	**37.910**	**3.881**	**–**
Anlagen insgesamt	**USD 51.015**	**USD 1.543.481**	**USD 1.005.122**	**USD 110.685**

	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	6.404	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(2.195)	(4)	–	–
	–	**4.209**	**(4)**	**–**	**–**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	USD 907.682	USD 990.058	USD 16.097	USD 564.432	USD 1.589.873
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	14.234	15.270	196	8.861	52.508
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	4.620	2.178	744	813	7.394
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(22.741)	(23.080)	(510)	(14.646)	(32.855)
	903.795	**984.426**	**16.527**	**559.460**	**1.616.920**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Anlagen insgesamt	**USD 903.795**	**USD 988.635**	**USD 16.523**	**USD 559.460**	**USD 1.616.920**

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	6.925
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	(3)	(11)	(8.095)
	–	**–**	**(3)**	**(11)**	**(1.170)**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	USD 100.268	USD 39.987	USD 10.214	USD 27.654	USD 347.001
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	2.795	808	21	228	16.394
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	2.832	582	272	372	3.313
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(2.613)	(1.095)	(255)	(617)	(14.536)
	103.282	**40.282**	**10.252**	**27.637**	**352.172**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Anlagen insgesamt	**USD 103.282**	**USD 40.282**	**USD 10.249**	**USD 27.626**	**USD 351.002**

	Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Value Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	3.299	314.143	14.790	194.647	1.288.674
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	3.299	**314.143**	**14.790**	**194.647**	**1.288.674**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	44	6.583	–	4.156	24.261
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	65
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(20)	(3)	–	–	(1.651)
	24	**6.580**	**–**	**4.156**	**22.675**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Anlagen insgesamt	**USD 3.323**	**USD 320.723**	**USD 14.790**	**USD 198.803**	**USD 1.311.349**

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)
Stufe 1				
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.110.314	33.733	12.413	503.606
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–
	1.110.314	**33.733**	**12.413**	**503.606**
Stufe 2				
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	8.965	300	10.147
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	6	1	–	74
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(882)	(28)	(12)	(667)
	(876)	**8.938**	**288**	**9.554**
Stufe 3				
Anleihen und Schuldtitel	USD –	USD –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**
Anlagen insgesamt	**USD 1.109.438**	**USD 42.671**	**USD 12.701**	**USD 513.160**

	Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)	Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund zum 31. August 2019 (in Tsd.)
Stufe 1				
Anleihen und Schuldtitel	USD –	EUR –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	73.303	43.732	70.295	11.847
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–
	73.303	**43.732**	**70.295**	**11.847**
Stufe 2				
Anleihen und Schuldtitel	USD –	EUR –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.017	1.140	5.167	995
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1	220	4	26
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(2)	(3)	(229)	(7)
	1.016	**1.357**	**4.942**	**1.014**
Stufe 3				
Anleihen und Schuldtitel	USD –	EUR –	USD –	USD –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–
	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	**USD 74.319**	**EUR 45.089**	**USD 75.237**	**USD 12.861**

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Uneingeschränkt Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	
Stufe 1								
Anleihen und Schuldtitel	USD	–	EUR	–	USD	–	USD	–
Geldmarktinstrumente		–		–		–		–
Eigenkapitalinstrumente		228.090		95.030		15.475		24.826
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte		–		–		–		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten		–		–		–		–
		228.090		**95.030**		**15.475**		**24.826**
Stufe 2								
Anleihen und Schuldtitel	USD	–	EUR	–	USD	–	USD	–
Geldmarktinstrumente		–		65.713		–		–
Eigenkapitalinstrumente		–		–		–		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte		–		6.815		–		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten		–		(4.300)		–		–
		–		**68.228**		**–**		**–**
Stufe 3								
Anleihen und Schuldtitel	USD	–	EUR	–	USD	–	USD	–
Geldmarktinstrumente		–		–		–		–
Eigenkapitalinstrumente		–		–		–		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte		–		–		–		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten		–		–		–		–
		–		**–**		**–**		**–**
Anlagen insgesamt	**USD**	**228.090**	**EUR**	**163.258**	**USD**	**15.475**	**USD**	**24.826**

	Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)		Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)		Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)		Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^ zum 31. August 2019 (in Tsd.)	
Stufe 1								
Anleihen und Schuldtitel	USD	–	EUR	–	EUR	–	USD	–
Geldmarktinstrumente		–		–		–		–
Eigenkapitalinstrumente		26.391		5.499		447.571		2.600
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte		–		–		–		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten		–		–		–		–
		26.391		**5.499**		**447.571**		**2.600**
Stufe 2								
Anleihen und Schuldtitel	USD	–	EUR	–	EUR	–	USD	–
Geldmarktinstrumente		–		–		–		–
Eigenkapitalinstrumente		–		–		11.655		90
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte		–		–		995		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten		–		–		(644)		(34)
		–		**–**		**12.006**		**56**
Stufe 3								
Anleihen und Schuldtitel	USD	–	EUR	–	EUR	–	USD	–
Geldmarktinstrumente		–		–		–		–
Eigenkapitalinstrumente		–		–		–		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte		–		–		–		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten		–		–		–		–
		–		**–**		**–**		**–**
Anlagen insgesamt	**USD**	**26.391**	**EUR**	**5.499**	**EUR**	**459.577**	**USD**	**2.656**

12. Sicherheiten für Wertpapiere

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 Kontrahenten, mit denen die Fonds Geschäfte abschließen, regelmäßig überprüft. Die Fonds dürfen nur mit genehmigten Kontrahenten handeln.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

12. Sicherheiten für Wertpapiere – (Fortsetzung)

Fonds	Makler	Zum 31. August 2019 Marktwert der Sicherheit (in Tsd.)	
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Barclays	USD	507
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	BNP Paribas	USD	607
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Citi	USD	1.076
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Goldman Sachs	USD	628
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Citi	USD	14
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	Citi	USD	38
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Citi	USD	25
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Bank of America Merrill Lynch	USD	72.519
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Goldman Sachs	USD	1.390
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Morgan Stanley	USD	89
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^	Citi	USD	248
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^	JP Morgan	USD	174
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	Barclays	USD	215
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	Citi	USD	822
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	JP Morgan	USD	184
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	Morgan Stanley	USD	161
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^	Credit Suisse	USD	237

Der Wert der als Sicherheit erhaltenen Basiswerte für gehandelte und von den folgenden Fonds gehaltenen Derivate betrug zum 31. August 2019:

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

Für die Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung kann jeder Fonds gemäß den Bestimmungen und Beschränkungen der Central Bank UCITS Regulations Wertpapierpensionsgeschäfte und umgekehrte Wertpapierpensionsgeschäfte sowie Wertpapierleihverträge abschließen.

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

(i) täglich neu bewertet werden;

(ii) jederzeit dem Wert des angelegten Betrags oder der geliehenen Wertpapiere entsprechen oder darüber liegen;

(iii) auf den Treuhänder oder seinen Beauftragten übertragen werden; und

(iv) dem Fonds sofort und ohne Rückgriff auf den Kontrahenten zur Verfügung stehen, falls dieses Rechtssubjekt in Verzug gerät.

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

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

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

Im Wesentlichen werden alle Barmittel und Wertpapiere der Fonds über die Verwahrstelle verwaltet. 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 Unteranlageverwalter den Barmittelbestand auf eine andere Bank übertragen.

Sämtliche als Sicherheit platzierte Wertpapiere sind in der Vermögensaufstellung aufgeführt. Die bei den Depositar- und Margenkonten gehaltenen Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente werden in der Finanzposition ausgewiesen.

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

Zur Reduzierung des Kontrahentenausfallrisikos werden bestimmte außerbörsliche Derivate über zentrale Clearingstellen abgewickelt. Im Rahmen dieses Arrangements werden mit Kontrahenten abgeschlossene Geschäfte an Clearingstellen abgetreten, die nach der Annahme effektiv den Kontrahenten für die Risikoaspekte der Transaktion ersetzen.

Die folgende Tabelle weist den Marktwert der Wertpapiere aus, die als Sicherheit bei Maklern in Bezug auf den Handel mit Derivaten zum 31. August 2019 platziert wurden:

Fonds	Makler	Zum 31. August 2019 Marktwert der Sicherheit (in Tsd.)	
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Citi	USD	1.094
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	Goldman Sachs	USD	49

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

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Der Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund hielt zum Ende des Berichtszeitraums 217.231, 79.419 bzw. 82.493 Anteile am Legg Mason Western Asset US High Yield Fund, 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 US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	
	Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2019 (in Tsd.)		Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2019 (in Tsd.)		Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2019 (in Tsd.)	
Ausgabe von Anteilen	USD	625	USD	188	USD	–
Rücknahme von Anteilen		(2.001)		–		(5.595)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		(284)		–		918
Erhaltene Ausschüttungen		625		187		–
Anschaffungskosten		19.723		8.211		13.374
Beizulegender Zeitwert		18.715		7.868		15.923
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	**USD**	**(1.008)**	**USD**	**(343)**	**USD**	**2.549**

^ 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 Emerging Markets Total Return Bond Fund

Der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund hielt am Ende des Berichtszeitraums 21.651 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 Berichtszeitraum zum 31. August 2019 (in Tsd.)	
Ausgabe von Anteilen	USD	54
Rücknahme von Anteilen		(474)
Realisierter Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		(29)
Erhaltene Ausschüttungen		54
Anschaffungskosten		1.992
Beizulegender Zeitwert		2.145
Nicht realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	**USD**	**153**

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Der Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund hielt am Ende des Berichtszeitraums 17.159 bzw. 26.331 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 Berichtszeitraum zum 31. August 2019 (in Tsd.)		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2019 (in Tsd.)	
Ausgabe von Anteilen	USD	2.692	USD	–
Rücknahme von Anteilen		(5.890)		–
Realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		269		–
Erhaltene Ausschüttungen		142		–
Anschaffungskosten		1.669		4.299
Beizulegender Zeitwert		1.700		5.083
Nicht realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	**USD**	**31**	**USD**	**784**

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Der Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ hielt am Ende des Berichtszeitraums 73.595 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 Berichtszeitraum zum 31. August 2019 (in Tsd.)	
Ausgabe von Anteilen	USD	173
Rücknahme von Anteilen		–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		–
Erhaltene Ausschüttungen		172
Anschaffungskosten		7.125
Beizulegender Zeitwert		7.291
Nicht realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	**USD**	**166**

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

Der Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ hielt am Ende des Berichtszeitraums 87.846 Anteile am 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 Berichtszeitraum zum 31. August 2019 (in Tsd.)	
Ausgabe von Anteilen	USD	–
Rücknahme von Anteilen		–
Realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		–
Erhaltene Ausschüttungen		–
Anschaffungskosten		10.310
Beizulegender Zeitwert		10.942
Nicht realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	**USD**	**632**

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

14. Bedeutende Ereignisse

Am 2. August 2019 stellte Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^ den Handel ein.

Weitere bedeutende Ereignisse gab es im Berichtszeitraum zum 31. August 2019 nicht.

15. Getrennte Haftung

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

16. Änderungen des Verkaufsprospekts

Am 22. März 2019 wurden ein aktualisierter Haupt- und ein aktualisierter Expertenprospekt von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt. Die bedeutendsten Änderungen sind:

- Ernennung von Legg Mason Investments (Ireland) Limited zur Verwaltungsgesellschaft von Legg Mason Global Funds plc. LMI Europe fungiert nicht mehr als Anlageverwalter. Im Abschnitt „Allgemeine Informationen" dieser Jahresabschlüsse finden Sie eine überarbeitete Aufstellung der Anlageverwalter und Unteranlageverwalter für jeden Fonds.
- Die Bewertungsgrundlage für alle von den Fonds gehaltenen Wertpapiere ist jetzt der neueste verfügbare mittlere Preis (anstelle des neuesten verfügbaren gehandelten Preises für Wertpapiere außer Anleihen und des Schlusskurses für Anleihen, die an einem geregelten Markt gehandelt werden). Darüber hinaus kann aufgrund der Änderung des Mid Pricing die Verwässerungsanpassung für Rentenfonds, die in der Vergangenheit nur bei Nettozeichnungen galt, nun auch bei Netto-Rücknahmen gelten.
- Die Offenlegung der europäischen Benchmark-Verordnung wurde aktualisiert, um den Plan des Unternehmens im Falle einer wesentlichen Änderung oder Einstellung einer von einem Fonds verwendeten Benchmark widerzuspiegeln.
- Die Offenlegung wurde hinzugefügt, um die neue EU-Verbriefungsverordnung zu berücksichtigen. Nach den neuen Vorschriften dürfen die Fonds, die Verbriefungen kaufen, nur solche Verbriefungen kaufen, deren Emittent, Sponsor oder ursprünglicher Kreditgeber mindestens 5 % netto an der Verbriefung hält. Als Folge der Verbriefungsverordnung sind bestimmte Verbriefungen, die zuvor von den Fonds gekauft werden durften, nun nicht mehr zulässig.

Bestimmte weitere Änderungen an einzelnen Fondszusätzen im Hauptprospekt wurden vorgenommen, wie in der Mitteilung an die Anteilsinhaber vom 14. Februar 2019 beschrieben. Diese Änderungen wurden am 22. März 2019 wirksam.

Am 17. Juni 2019 überarbeitete das Unternehmen seinen Hauptprospekt vom 22. März 2019, vor allem um den für die Verwaltung des Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^ (der „Fonds") relevanten Index zu ändern. Der vorherige Index hat kürzlich China hinzugefügt, und daher musste der Fonds gemäß der Anlagepolitik ein gewisses Engagement in der chinesischen Währung (CNY) haben. Seit dem 3. Mai 2019 machte dieses Engagement 1,10 % des Nettoinventarwerts des Fonds aus. Der Anlageverwalter des Fonds war nicht der Ansicht, dass die chinesische Währung einen günstigen Ausblick hatte, und beantragte daher, den Index des Fonds durch einen Index zu ersetzen, der kein chinesisches Engagement beinhaltet. Die Änderung bedeutet, dass der Fonds nach den Anlagestrategien nicht mehr zu einem Engagement in die chinesische Währung verpflichtet ist.

17. Spätere Ereignisse

Mit Wirkung vom 19. September 2019 wurden Jaspal Sagger und Victoria Rock als Mitglieder des Verwaltungsrats der Gesellschaft berufen. Es gab keine sonstigen wesentlichen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag, die im Abschluss offengelegt werden müssten.

18. Vergleichszahlen aus dem letzten Berichtszeitraum

Die Vergleichszahlen aus dem Vorjahreszeitraum für die Bilanz entsprechen dem Stand vom 28. Februar 2019. Die Vergleichszahlen aus dem Vorjahreszeitraum für die Gesamtergebnisrechnung und die Aufstellung der Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens sind für den Berichtszeitraum zum 31. August 2018.

19. Genehmigung der Abschlüsse

Am 11. Oktober 2019 wurden der Halbjahresbericht und der ungeprüfte Zwischenabschluss dem Verwaltungsrat vorgelegt und von diesem zur Kenntnis genommen und für die Einreichung bei der Central Bank sowie zur Verbreitung an die Anteilsinhaber genehmigt.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios - TER)

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	
Klasse A USD thesaurierend	0,67
Klasse A USD ausschüttend (D)	0,67
Klasse B USD, thesaurierend	1,12
Klasse C USD, thesaurierend	1,37
Klasse C USD ausschüttend (D)	1,37
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,46
Klasse A (G) USD, thesaurierend	0,67
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	0,67
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	0,67
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,22
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,22
Klasse B USD ausschüttend (D)	1,48
Klasse C USD, thesaurierend	1,72
Klasse C USD ausschüttend (D)	1,72
Klasse E USD thesaurierend	1,81
Klasse F USD, thesaurierend	0,67
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,67
Klasse X USD, thesaurierend	0,75
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,75
Klasse Premier USD thesaurierend	0,42
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,41
Klasse GA USD thesaurierend	0,94
Klasse GE USD thesaurierend	1,54
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,39
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,39
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,39
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,39
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,39
Klasse B USD ausschüttend (D)	1,64
Klasse C USD, thesaurierend	1,89
Klasse C USD ausschüttend (D)	1,89
Klasse E USD thesaurierend	1,99
Klasse F USD, thesaurierend	0,64
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,64
Klasse X USD, thesaurierend	0,82
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,82
Klasse Premier USD thesaurierend	0,39
Klasse Premier USD ausschüttend (M)	0,39
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,40
Klasse LM Euro thesaurierend	0,09
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	0,10
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,24
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,24
Klasse B (G) USD ausschüttend (D)	1,73
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,74
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	1,74
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,28
Klasse A Euro ausschüttend (D)	1,28
Klasse C USD ausschüttend (D)	1,78
Klasse F EUR, ausschüttend (Q)	0,65
Klasse Premier Euro thesaurierend	0,42
Klasse LM Euro thesaurierend	0,13
Klasse GA Euro thesaurierend	0,95
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	0,95
Klasse GE Euro thesaurierend	1,55
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,40
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,40
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,40
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,40
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,40
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,40
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,40
Klasse B USD, thesaurierend	1,65
Klasse B USD ausschüttend (D)	1,65
Klasse C USD, thesaurierend	1,90
Klasse C USD ausschüttend (D)	1,90
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,55
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,55
Klasse B (G) USD ausschüttend (D)	2,07
Klasse L (G) USD thesaurierend	2,05
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	2,05

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,35
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,35
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,35
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,35
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,35
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	1,35
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,35
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	1,35
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,35
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35
Klasse B USD, thesaurierend	1,60
Klasse B USD ausschüttend (D)	1,60
Klasse C USD, thesaurierend	1,85
Klasse C USD ausschüttend (D)	1,85
Klasse A HKD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34
Klasse E USD thesaurierend	1,95
Klasse E USD ausschüttend (D)	1,95
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,95
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,95
Klasse F USD, thesaurierend	0,75
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,75
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,80
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,80
Klasse Premier USD thesaurierend	0,50
Klasse Premier USD ausschüttend (M)	0,50
Klasse Premier CHF, thesaurierend (Abgesichert)	0,50
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,50
Klasse Premier Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	0,49
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,50
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	0,50
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	0,50
Klasse Premier GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)	0,50
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	0,50
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,10
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	0,10
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,44
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,44
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,44
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,44
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	1,44
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,44
Klasse B USD, thesaurierend	1,69
Klasse B USD ausschüttend (D)	1,69
Klasse C USD, thesaurierend	1,94
Klasse C USD ausschüttend (D)	1,94
Klasse E USD thesaurierend	2,04
Klasse E USD ausschüttend (D)	2,04
Klasse F USD, thesaurierend	0,84
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,84
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)	0,85
Klasse Premier USD thesaurierend	0,59
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,58
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,58
Klasse LM USD, thesaurierend	0,14
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,14
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	0,13
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,29
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,29
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,79
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	1,79
Klasse GF USD thesaurierend	1,09
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,78
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,79
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,79
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,78
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,78
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,79
Klasse A GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,79
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,79
Klasse B USD ausschüttend (D)	2,05
Klasse C USD, thesaurierend	2,29
Klasse C USD ausschüttend (D)	2,29
Klasse E USD ausschüttend (D)	2,56
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,55
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	2,56
Klasse F USD, thesaurierend	1,11
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,21
Klasse Premier USD thesaurierend	0,86
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,86
Klasse Premier GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	0,86
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,56
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,56
Klasse L (G) USD thesaurierend	2,06
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	2,06

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

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,91
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,91
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,20
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,54
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,54
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,55
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,55
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,55
Klasse A Euro thesaurierend	1,54
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,55
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,55
Klasse B USD, thesaurierend	1,79
Klasse B USD ausschüttend (D)	1,79
Klasse C USD, thesaurierend	2,04
Klasse C USD ausschüttend (D)	2,04
Klasse E USD thesaurierend	2,15
Klasse E USD ausschüttend (D)	2,15
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,14
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	2,15
Klasse F USD, thesaurierend	0,85
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,84
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,93
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,93
Klasse Premier USD thesaurierend	0,60
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,60
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,60
Klasse Premier GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	0,60
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,40
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,40
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,90
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	1,90
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,20
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,20
Klasse B USD, thesaurierend	1,45
Klasse C USD, thesaurierend	1,70
Klasse C USD ausschüttend (A)	1,70
Klasse LM USD, thesaurierend	0,23
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,00
Klasse A (G) USD, ausschüttend (A)	1,00
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,50
Klasse L (G) USD, ausschüttend (A)	1,50
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,35
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,35
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,35
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,35
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,35
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35
Klasse A Euro thesaurierend	1,35
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,35
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,35
Klasse A GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,35
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,35
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,35
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1,35
Klasse B USD, thesaurierend	1,60
Klasse B USD ausschüttend (D)	1,60
Klasse C USD, thesaurierend	1,85
Klasse C USD ausschüttend (D)	1,85
Klasse E USD thesaurierend	1,95
Klasse E USD ausschüttend (D)	1,95
Klasse F USD, thesaurierend	0,95
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,95
Klasse X USD ausschüttend (M)	0,85
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,85
Klasse Premier USD thesaurierend	0,70
Klasse Premier USD ausschüttend (M)	0,70
Klasse Premier Euro thesaurierend	0,70
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,70
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,70
Klasse Premier Euro ausschüttend (M)	0,70
Klasse Premier GBP ausschüttend (M)	0,70
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,14
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,14
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,12
Klasse B USD, thesaurierend	1,39
Klasse C USD, thesaurierend	1,64
Klasse C USD, ausschüttend (M)	1,65
Klasse E USD thesaurierend	1,75
Klasse E USD ausschüttend (D)	1,75
Klasse F USD, thesaurierend	0,74
Klasse Premier USD thesaurierend	0,48
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,46
Klasse Premier Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	0,48
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,48
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	0,49
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,38
Klasse S Euro, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,37
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,38
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,36
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,36
Klasse X USD, thesaurierend	0,81
Klasse Premier USD thesaurierend	0,51
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,51
Anteilsklasse Premier NZD thesaurierend (mit Absicherung)	0,51
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	0,11
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,35
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,36
Klasse LM USD, thesaurierend	0,16
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	
Klasse A Euro ausschüttend (D)	1,45
Klasse Premier Euro thesaurierend	0,59
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,59
Klasse LM Euro thesaurierend	0,16

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

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Klasse LM Euro ausschüttend (Q)	0,16
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,74
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,74
Klasse A USD ausschüttend (S)	1,74
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A CNH thesaurierend (mit Absicherung)	1,74
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,74
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,73
Klasse A Euro ausschüttend (S) (abgesichert)	1,74
Klasse A GBP thesaurierend	1,74
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,70
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus (e)	1,73
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74
Klasse B USD, thesaurierend	1,99
Klasse C USD, thesaurierend	2,24
Klasse C USD ausschüttend (S)	2,24
Klasse A NOK thesaurierend (mit Absicherung)	1,74
Klasse E USD thesaurierend	2,34
Klasse E USD ausschüttend (S)	2,34
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,34
Klasse F USD, thesaurierend	1,34
Klasse F USD, ausschüttend (S)	1,34
Klasse X USD, thesaurierend	1,24
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,24
Klasse X USD, ausschüttend (S)	1,24
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)	1,24
Klasse X EUR thesaurierend	1,23
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,24
Klasse X EUR ausschüttend (A) (mit Absicherung)	1,24
Klasse X EUR ausschüttend (M) (mit Absicherung)	1,24
Klasse X GBP, thesaurierend	1,24
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)	1,24
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,24
Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,24
Klasse Premier USD thesaurierend	1,09
Klasse Premier USD ausschüttend (S)	1,09
Klasse Premier AUD thesaurierend (mit Absicherung)	1,09
Klasse Premier AUD ausschüttend (S) (mit Absicherung)	1,09
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	1,14
Klasse Premier CHF, thesaurierend (Abgesichert)	1,09
Klasse Premier CHF ausschüttend (S) (abgesichert)	1,09
Klasse Premier Euro thesaurierend	1,09
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	1,09
Klasse Premier EUR ausschüttend (S) (mit Absicherung)	1,09
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,09
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	1,09
Klasse Premier JPY thesaurierend (abgesichert)	1,09
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	1,09
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)	1,09
Klasse S USD, thesaurierend	0,69
Klasse S Euro, thesaurierend (abgesichert)	0,69
Klasse LM AUD ausschüttend (S) (mit Absicherung)	0,09
Klasse LM Euro thesaurierend	0,09
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^	
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,50
Klasse Premier USD thesaurierend	0,65
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,20
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,50
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,55
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,50
Klasse C USD, thesaurierend	2,05
Klasse E USD thesaurierend	2,15
Klasse F USD, thesaurierend	0,89
Klasse X CHF ausschüttend (M) (abgesichert)	0,87
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,69
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,10
Klasse LM Euro thesaurierend (abgesichert)	0,09
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	0,10
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,49
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,50
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,50
Klasse Premier USD thesaurierend	0,75
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,75
Klasse Premier JPY thesaurierend (abgesichert)	0,75

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Klasse Premier JPY ausschüttend (S) (abgesichert)	0,75
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,44
Klasse M Euro, thesaurierend (abgesichert)	1,44
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	1,44
Klasse D USD, thesaurierend	1,44
Klasse D USD, ausschüttend (M)	1,44
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,44
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)	0,84
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	0,84
Klasse F USD, thesaurierend	1,29
Klasse M USD ausschüttend (M)	0,84
Klasse M Euro, thesaurierend (abgesichert)	0,84
Klasse Premier USD thesaurierend	0,69
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)	0,69
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,69
Klasse Premier Euro ausschüttend (Q) (abgesichert)	0,69
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	0,69
Klasse LM USD, thesaurierend	0,09
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,24
Klasse Premier USD thesaurierend	0,39
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,39
Klasse LM USD, thesaurierend	0,09
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,07
Klasse Premier USD thesaurierend	0,42
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,42
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	0,12
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,35
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,35
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,40
Klasse A USD ausschüttend (S)	1,35
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,35
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert) (AH)	1,35
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,35
Klasse A EUR, ausschüttend (S)	1,35
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (AH)	1,35
Klasse A GBP thesaurierend	1,35
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	1,35
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (AH)	1,35
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,33
Klasse A SGD thesaurierend	1,35
Klasse B USD, thesaurierend	1,60
Klasse B USD ausschüttend (S)	1,60
Klasse C USD, thesaurierend	1,85
Klasse C USD ausschüttend (S)	1,85
Klasse E USD thesaurierend	1,95
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,95
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (AH)	1,95
Klasse F USD, thesaurierend	0,95
Klasse F USD, ausschüttend (S)	0,95
Klasse R USD, ausschüttend (S)	0,95
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (AH)	0,95
Klasse X USD, thesaurierend	0,85
Klasse X USD, ausschüttend (S)	0,85
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,85
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,85
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (EUR)	0,85
Klasse X GBP, thesaurierend	0,85
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)	0,85
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung) (AH)	0,85
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,85
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (GBP)	0,85
Klasse Premier USD thesaurierend	0,70
Klasse Premier USD ausschüttend (S)	0,70
Klasse Premier Euro thesaurierend	0,70
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,70
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,70
Klasse Premier EUR ausschüttend (S)	0,70
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	0,70
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (AH)~	0,70
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,10

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,59
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,59
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,59
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,66
Klasse C USD, thesaurierend	2,09
Klasse E USD thesaurierend	2,19
Klasse E USD ausschüttend (A)	2,19
Klasse F USD, thesaurierend	1,19
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,19
Klasse X USD, thesaurierend	1,14
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,14
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)	1,14
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,14
Klasse Premier USD thesaurierend	0,99
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,99
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,99
Klasse Premier Euro ausschüttend (A) (abgesichert)	0,99
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	0,99
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)	0,99
Klasse Premier SGD thesaurierend (abgesichert)	0,99
Klasse LM USD, thesaurierend	0,09
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,09
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,39
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,39
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,89
Klasse Premier USD thesaurierend	0,69
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,69
Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,59
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,40
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,40
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,40
Klasse C USD, thesaurierend	1,90
Klasse E USD thesaurierend	2,00
Klasse F USD, thesaurierend	1,00
Klasse F USD, ausschüttend (M)	1,00
Klasse X USD, thesaurierend	0,90
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,90
Klasse X GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) (AH)	0,91
Klasse Premier USD thesaurierend	0,75
Klasse Premier USD thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,74
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (AH)	0,74
Klasse Premier NZD thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,74
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10
Klasse LM Euro thesaurierend	0,10
Klasse LM NZD thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,09
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,83
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,82
BW Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,09
BW Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,08
BW Klasse LM GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (AH)	0,08
Klasse BW Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,43
Klasse BW Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,43
Klasse BW Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (AH)	0,43
Klasse BW Premier USD, thesaurierend	0,50
Klasse Premier USD thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,44
Klasse X USD, thesaurierend	1,10
Klasse Premier USD thesaurierend	0,88
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,87
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,39
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,39
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,39
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,39
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,39
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,39
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,39
Klasse C USD ausschüttend (D)	1,91
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,00
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,94
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,84
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,84
Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,84
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,84
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,70
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,69
Klasse Premier Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,69
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	0,70
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)	0,69
Klasse S Euro, thesaurierend (abgesichert)	0,60
Klasse S Euro, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,60
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,60
Klasse LM AUD ausschüttend (Q) (mit Absicherung)	0,16

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,95
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,95
Klasse Premier USD thesaurierend	1,30
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,30
Klasse LM USD, thesaurierend	0,15
Klasse S SGD, thesaurierend (abgesichert)	0,75
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,34
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (AH)	0,55
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	2,28
Klasse X USD, thesaurierend	1,43
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,43
Klasse Premier USD thesaurierend	1,26
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	1,28
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,10
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	0,09
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,70
Klasse Premier USD thesaurierend	0,75
Klasse S USD, thesaurierend	0,50
Klasse S Euro, thesaurierend (abgesichert)	0,50
Legg Mason ClearBridge Value Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,81
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,81
Klasse A Euro thesaurierend	1,81
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,81
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	1,81
Klasse A SGD thesaurierend	1,81
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,81
Klasse B USD ausschüttend (A)	2,30
Klasse C USD, thesaurierend	2,31
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,31
Klasse F USD, thesaurierend	1,21
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,21
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,13
Klasse Premier USD thesaurierend	0,78
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,78
Klasse Premier Euro thesaurierend	0,78
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,85
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,90
Klasse C USD, thesaurierend	2,35
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,40
Klasse Premier USD thesaurierend	0,94
Klasse LM USD, thesaurierend	0,15
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,72
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,72
Klasse A Euro thesaurierend	1,72
Klasse B USD, thesaurierend	2,22
Klasse B USD ausschüttend (A)	2,22
Klasse C USD, thesaurierend	2,22
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,22
Klasse E USD thesaurierend	2,47
Klasse E USD ausschüttend (A)	2,47
Klasse F USD, thesaurierend	1,12
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,12
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,09
Klasse X EUR thesaurierend	1,09
Klasse Premier USD thesaurierend	0,74
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,74
Klasse Premier Euro thesaurierend	0,74
Klasse LM USD, thesaurierend	0,12
Klasse LM Euro thesaurierend	0,12
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,37
Klasse B (G) USD, thesaurierend	2,35
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,87
Klasse GA USD thesaurierend	1,54
Klasse GA Euro thesaurierend	1,54
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	1,54
Klasse GE USD thesaurierend	2,29
Klasse GE Euro thesaurierend	2,29

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

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

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,70
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,70
Klasse A Euro thesaurierend	1,70
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,70
Klasse B USD, thesaurierend	2,20
Klasse B USD ausschüttend (A)	2,20
Klasse C USD, thesaurierend	2,20
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,20
Klasse E USD thesaurierend	2,45
Klasse E USD ausschüttend (A)	2,45
Klasse F USD, thesaurierend	1,10
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,10
Klasse GP USD thesaurierend	0,62
Klasse E Euro thesaurierend	0,62
Klasse X USD, thesaurierend	1,07
Klasse X EUR thesaurierend	1,07
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,07
Klasse X EUR ausschüttend (A) (mit Absicherung)	1,07
Klasse X GBP, thesaurierend	1,07
Klasse Premier USD thesaurierend	0,72
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	0,67
Klasse Premier Euro thesaurierend	0,72
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,72
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,72
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10
Klasse LM Euro thesaurierend	0,10
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,35
Klasse B (G) USD, thesaurierend	1,83
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,85
Klasse GA USD thesaurierend	1,52
Klasse GA Euro thesaurierend	1,52
Klasse GE USD ausschüttend (A)	2,27
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,75
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,75
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse A CNH thesaurierend (mit Absicherung)	1,75
Klasse A Euro thesaurierend	1,75
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,75
Klasse A GBP thesaurierend	1,75
Klasse A HKD thesaurierend	1,75
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse B USD, thesaurierend	2,25
Klasse B USD ausschüttend (A)	2,25
Klasse C USD, thesaurierend	2,25
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,25
Klasse E USD thesaurierend	2,50
Klasse E USD ausschüttend (A)	2,50
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,50
Klasse F USD, thesaurierend	1,15
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,15
Klasse X USD, thesaurierend	1,10
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,10
Klasse X EUR thesaurierend	1,10
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,10
Klasse X GBP, thesaurierend	1,10
Klasse Premier USD thesaurierend	0,75
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,55
Klasse Premier Euro thesaurierend	0,75
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,75
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,75
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,75
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,75
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,75
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	0,75
Klasse LM Euro thesaurierend	0,10
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,40
Klasse B (G) USD, thesaurierend	1,90
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,90
Klasse GA Euro thesaurierend	1,52
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	1,52
Klasse GE USD thesaurierend	2,27
Klasse GE Euro thesaurierend	2,27

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,75
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,75
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,75
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,75
Klasse A USD ausschüttend (Q)	1,75
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75
Klasse A Euro thesaurierend	1,75
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,75
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,75
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75
Klasse B USD, thesaurierend	2,25
Klasse B USD ausschüttend (A)	2,25
Klasse C USD, thesaurierend	2,25
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,25
Klasse C USD ausschüttend (Q)	2,25
Klasse F USD, thesaurierend	1,15
Klasse F EUR, thesaurierend	1,15
Klasse F EUR ausschüttend (A)	1,15
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,13
Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,13
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,78
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,70
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,70
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,10
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,10
Klasse X GBP, thesaurierend	1,10
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,75
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,75
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,75
Klasse S USD, thesaurierend	0,15
Klasse S GBP, thesaurierend	0,15
Klasse S GBP, ausschüttend (M)	0,15
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,95
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,95
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,95
Klasse A CNH thesaurierend (mit Absicherung)	1,95
Klasse A Euro thesaurierend	1,95
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,95
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,95
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,95
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	1,95
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,95
Klasse A SGD thesaurierend	1,95
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,95
Klasse B USD, thesaurierend	2,45
Klasse B USD ausschüttend (A)	2,45
Klasse C USD, thesaurierend	2,45
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,45
Klasse E USD thesaurierend	2,70
Klasse E USD ausschüttend (A)	2,70
Klasse E Euro thesaurierend	2,70
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,70
Klasse F USD, thesaurierend	1,35
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,35
Klasse R USD thesaurierend	1,46
Klasse R EUR thesaurierend	1,45
Klasse X USD, thesaurierend	1,20
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,20
Klasse X EUR thesaurierend	1,20
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,20
Klasse X GBP, thesaurierend	1,20
Klasse X GBP, ausschüttend (A)	1,20
Klasse Premier USD thesaurierend	0,85
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	0,85
Klasse Premier Euro thesaurierend	0,85
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert)	0,85
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,85
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	0,85

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

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

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
Klasse A USD thesaurierend	2,00
Klasse A USD, ausschüttend (A)	2,01
Klasse A Euro thesaurierend	2,01
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,00
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	2,01
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	2,01
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	2,00
Klasse B USD, thesaurierend	2,50
Klasse C USD, thesaurierend	2,50
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,51
Klasse E USD thesaurierend	2,76
Klasse E USD ausschüttend (A)	2,76
Klasse E Euro thesaurierend	2,75
Klasse F USD, thesaurierend	1,41
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,41
Klasse R USD thesaurierend	1,51
Klasse X USD, thesaurierend	1,26
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,24
Klasse Premier USD thesaurierend	0,91
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,91
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,91
Klasse LM Euro thesaurierend	0,16
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,41
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,91
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,85
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	1,85
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,85
Klasse A USD ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,85
Klasse A USD ausschüttend (Q) (abgesichert)	1,85
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85
Klasse A Euro thesaurierend	1,87
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,85
Klasse A EUR ausschüttend (M) Plus	1,85
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85
Klasse B USD, thesaurierend	2,35
Klasse B USD ausschüttend (A)	2,35
Klasse C USD, thesaurierend	2,35
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,35
Klasse E USD thesaurierend (abgesichert)	2,60
Klasse F USD, thesaurierend	1,25
Klasse F USD ausschüttend (Q) (abgesichert)	1,25
Klasse Premier Euro thesaurierend	0,85
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	0,85
Klasse LM USD, thesaurierend	0,22
Klasse LM Euro thesaurierend	0,22
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,57
Klasse B (G) USD, thesaurierend	2,07
Klasse L (G) USD thesaurierend	2,07
Klasse GA USD thesaurierend	1,64
Klasse GA Euro thesaurierend	1,64
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	1,64
Klasse GE USD thesaurierend	2,39
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,85
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,85
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,85
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85
Klasse A Euro thesaurierend	1,85
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,85
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85
Klasse B USD ausschüttend (A)	2,35
Klasse C USD, thesaurierend	2,35
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,35
Klasse E USD thesaurierend	2,64
Klasse E USD ausschüttend (A)	2,64
Klasse F USD, thesaurierend	1,29
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,29
Klasse X EUR thesaurierend	1,18
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	0,86
Klasse GA USD thesaurierend	1,81
Klasse GA Euro thesaurierend	1,81
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	1,81
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	0,15
Klasse GE USD thesaurierend	2,56
Klasse GE Euro thesaurierend	2,56

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,85
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,85
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,85
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85
Klasse GA USD thesaurierend	1,98
Klasse GA Euro thesaurierend	1,98
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	1,98
Klasse GE USD thesaurierend	2,73
Klasse GE Euro thesaurierend	2,73
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	2,00
Klasse M GBP ausschüttend (A)	1,20
Klasse E USD thesaurierend	2,75
Klasse F USD, thesaurierend	1,40
Klasse M USD ausschüttend (A)	1,20
Klasse M Euro ausschüttend (A)	1,20
Klasse Premier USD thesaurierend	0,76
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,76
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,95
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,95
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,25
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	2,00
Klasse A Euro thesaurierend	2,00
Klasse E USD thesaurierend	2,75
Klasse X EUR thesaurierend	1,24
Klasse X GBP, thesaurierend	1,25
Klasse X GBP thesaurierend (mit Absicherung)	1,25
Klasse Premier USD thesaurierend	0,90
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,90
Klasse S GBP, thesaurierend	0,55
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	2,00
Klasse E USD thesaurierend	2,75
Klasse F USD, thesaurierend	1,40
Klasse X USD, thesaurierend	1,25
Klasse Premier USD thesaurierend	0,90
Klasse S USD, thesaurierend	0,70
Klasse S Euro, thesaurierend	0,70
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	
Klasse A Euro thesaurierend	2,00
Klasse X EUR thesaurierend	1,25
Klasse Premier Euro thesaurierend	0,90
Klasse S Euro, thesaurierend	0,50

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	2,00
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	1,95
Klasse A USD ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,95
Klasse A USD ausschüttend (Q)	1,95
Klasse A Euro thesaurierend	1,95
Klasse A EUR ausschüttend (M) Plus	1,95
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,95
Klasse C USD, thesaurierend	2,45
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)	2,45
Klasse E USD thesaurierend	2,70
Klasse F USD, thesaurierend	1,35
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)	1,35
Klasse X USD, thesaurierend	1,05
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,08
Klasse X EUR thesaurierend	1,05
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	1,04
Klasse Premier USD thesaurierend	0,88
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	0,83
Klasse Premier CAD ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,89
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)	0,88
Klasse Premier Euro thesaurierend	0,88
Klasse Premier Euro thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,85
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,88
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,88
Klasse Premier GBP ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,88
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	0,86
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (AH)	0,09

	Verhältnis der Gesamten Betriebsausgaben in CU(1) zu den durchschnittlichen Nettoaktiva des Fonds pro Tag in CU(1)(%) Für den abgeschlossenen Zeitraum 31. August 2019**
Legg Mason RARE 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 Euro thesaurierend (abgesichert)	1,15

Die Berechnungsmethode für die Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) ist auf der Website der Swiss Funds and Asset Management Association (SFAMA) (www.sfama.ch) beschrieben.

(1) WE = Währungseinheiten in der Rechnungslegungswährung des Fonds

** Für Zeiträume unter einem Jahr auf das Jahr hochgerechnet

*** TER einschließlich der Leistungsgebühr

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands

August 2019 für den Zeitraum beendet

Gemäß den OGAW-Verordnungen wird eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen der Zusammensetzung des Anlageportfolios jedes Fonds während des Berichtsjahres bereitgestellt, um sicherzustellen, dass die Anteilsinhaber Änderungen bei den von jedem Fonds gehaltenen Anlagen identifizieren können. Diese Veränderungen bestehen aus den Gesamtankäufen und -verkäufen einer Investition (einschließlich der Fälligkeiten und ausschließlich der Rückkaufvereinbarungen, Diskontanleihen und Termingeldanlagen, die von einem Tag auf den anderen getätigt werden und die hauptsächlich dazu dienen, die Portfolios effizient zu verwalten), die 1,00 % des Gesamtwertes der Ankäufe und Verkäufe für das Geschäftsjahr übersteigen. Mindestens die zwanzig größten Kauf- und Verkaufstransaktionen sind hier aufgeführt. Sollte ein Fonds während des Geschäftsjahres weniger als zwanzig Käufe oder Verkäufe getätigt haben, sind alle Transaktionen aufgeführt.

Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Federal Home Loan Banks Discount Notes, zero coupon, due 3/14/2019	176.844
United States Treasury Bill, zero coupon due 6/11/2019	171.688
Federal Home Loan Banks Discount Notes, zero coupon, due 3/13/2019	152.679
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/5/2019	144.026
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/6/2019	142.190
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/8/2019	142.035
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/11/2019	135.355
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/4/2019	129.975
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/11/2019	127.490
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/12/2019	124.272
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/7/2019	118.853
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 6/27/2019	99.994
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 6/28/2019	99.994
Fannie Mae Discount Notes, zero coupon, due 7/1/2019	99.982
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/8/2019	99.982
United States Treasury Bill, zero coupon, due 6/13/2019	99.846
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/2/2019	99.694
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/10/2019	98.874
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/15/2019	97.273
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/9/2019	95.495
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/12/2019	81.402
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 6/12/2019	77.580
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/15/2019	74.995
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 6/13/2019	74.995
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 4/3/2019	74.995
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 4/4/2019	74.995
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/5/2019	74.991
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 4/2/2019	74.840
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 4/1/2019	74.831
Federal Farm Credit Discount Notes, zero coupon, due 9/23/2019	73.557
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/3/2019	73.430
United States Treasury Bill, zero coupon, due 4/9/2019	64.460

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/8/2019	186.909
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/14/2019	176.855
United States Treasury Bill, zero coupon, due 6/11/2019	171.761
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/5/2019	169.035
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/13/2019	152.689
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/1/2019	150.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/6/2019	142.199
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/11/2019	135.381
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/4/2019	130.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/11/2019	127.497
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/12/2019	124.280
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 3/7/2019	118.861
United States Treasury Bill, zero coupon, due 6/13/2019	100.073
Fannie Mae Discount Notes, zero coupon, due 7/1/2019	100.000
Federal Home Loan Banks Discount Notes, zero coupon, due 6/27/2019	100.000
Federal Home Loan Banks Discount Notes, zero coupon, due 6/28/2019	100.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/8/2019	100.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/2/2019	99.700
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/10/2019	98.878
Federal Home Loan Banks Discount Notes, zero coupon, due 7/15/2019	97.290
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/9/2019	95.501
Federal Home Loan Banks Discount Notes, zero coupon, due 3/29/2019	85.385
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/12/2019	81.413
Federal Home Loan Banks Discount Notes, zero coupon, due 3/21/2019	79.021
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 6/12/2019	77.585
Federal Home Loan Banks Discount Notes, zero coupon, due 3/15/2019	75.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 4/3/2019	75.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 4/4/2019	75.000
Federal Home Loan Banks Discount Notes, zero coupon, due 6/13/2019	75.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/5/2019	75.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 4/1/2019	74.845
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 4/2/2019	74.845
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 7/3/2019	73.435
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 5/3/2019	66.895
United States Treasury Bill, zero coupon, due 3/26/2019	66.458

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	116.909
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	13.315
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	9.662
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	8.210
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, due 5/15/2029	7.095
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,000 %	6.686
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	6.684
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	6.285
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	5.920
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,000 %	5.767
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	5.641
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	5.499
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	5.479
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	5.456
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	4.765
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 6/15/2022	4.535
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,500 %	4.531
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 3/31/2026	3.942
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	3.340
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 4,500 %	3.107

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	113.919
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	13.353
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	9.687
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	8.820
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	6.701
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,000 %	6.695
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	6.311
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, due 5/15/2029	6.107
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	5.967
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	5.898
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,000 %	5.771
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,000 %	5.652
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	5.641
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	5.512
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	5.455
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	5.364
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	4.791
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,500 %	4.636
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 6/15/2022	4.541
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,500 %	4.538
Freddie Mac Gold Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	4.210

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	77.723
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, due 5/15/2029	48.967
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 8/15/2049	47.803
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2048	40.515
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	38.417
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	31.775
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	30.393
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 6/15/2022	30.372
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, due 8/15/2047	29.567

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	77.982
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, due 5/15/2029	49.098
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, due 11/15/2048	42.930
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	31.855
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	30.525
United States Treasury Note/Bond, 1,75 %, due 6/15/2022	30.409
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 5/15/2047	30.240
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	29.425
Freddie Mac Gold Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	27.584

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

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

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	29.198
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	26.475
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	26.471
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	25.871
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,000 %	24.879
United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, due 2/28/2021	22.783
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	22.119
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	22.075
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 7/15/2022	21.603
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 4/30/2021	20.223
Fannie Mae Pool, 15 year, TBA, 3,500 %	19.400

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	26.543
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	25.987
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	25.938
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,000 %	25.178
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,000 %	24.933
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	24.785
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 4,000 %	23.047
Freddie Mac Gold Pool, 30 year, TBA, 4,000 %	22.361
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	22.111
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	22.092
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 7/15/2022	21.630
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	20.997
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	20.340
Fannie Mae Pool, 15 year, TBA, 3,000 %	19.423
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	18.960
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 6/30/2026	18.879
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,000 %	18.513
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 4,000 %	18.467
Freddie Mac, 30 Jahre, 4,000 %	17.162
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	16.261

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR
Republic of Poland Government Bond, Series 0428, 2,750 %, due 4/25/2028	4.538
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, due 4/15/2024	3.738
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	2.813
144A, 0,050 %, due 12/18/2029	2.374
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250 %, due 9/1/2046	1.987
OK, 1,250 %, due 5/25/2033	1.910
Landwirtschaftliche Rentenbank, 0,050 %, due 5/25/2033	1.909
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	1.412
Export-Import Bank of Korea, 0,375 %, due 3/26/2024	1.148
ING Bank, 0,375 %, due 5/16/2029	1.017
Spain Government Bond, 144A, 2,700 %, due 10/31/2048	1.005
Korea Development Bank/The, 0,000 %, due 7/10/2024	789
ING Bank, 0,500 %, due 3/21/2029	776
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, due 2/15/2027	745
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 2,550 %, due 9/15/2041	701
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, due 2/15/2028	641
Mexico Government International Bond, 2,000 %, due 7/9/2039	636
Mexico Government International Bond, 1,375 % due 1/15/2025	600
SpareBank 1 SMN, 0,750 %, fällig am 7/3/2023	413
Danske Bank A/S, 0,750 %, fällig am 6/2/2023	402
Medtronic Global Holdings SCA, 1,125 %, fällig am 3/7/2027	378
TenneT Holding BV, 1,375 %, due 6/5/2028	354
Europcar Groupe SA, 4,000 % due 4/30/2026	340

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, due 2/15/2027	9.174
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,000 %, due 12/1/2025	8.129
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, due 2/15/2026	5.032
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	2.736
OK, 1,250 %, due 5/25/2033	1.909
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 3,250 %, due 7/4/2042	1.068
Grand City Properties SA, 1,375 %, fällig am 8/3/2026	900
JPMorgan Chase & Co, 2,250 %, due 5/25/2028	704
Swedbank AB, 1,000 %, due 11/22/2027	652
Petroleos Mexicanos, 5.500 %, due 2/24/2025	553
SpareBank 1 SMN, 0,750 %, fällig am 6/8/2021	407
Danske Bank A/S, 0,500 %, fällig am 5/6/2021	394
Tennet Holding BV, 4.625 % due 2/21/2023	340
Gibson Brands Inc, 4.000 % due 10/1/2026	315
Codere Finance Luxembourg SA, 3.500 % due 6/15/2024	304
HSBC Holdings Plc, 2,125 %, due 6/18/2021	302
Telefonica Emiliones 2,9320 % Eseur 17/10/29 Eur, 2,932 %, due 10/17/2029	302
Royal Bank of Scotland Group Plc, 3,625 %, due 3/25/2024	298
Virgin Media Secured Finance Plc, 5,500 %, due 1/15/2025	295
Europcar Groupe SA, 5,750 % due 6/15/2022	284

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, due 2/15/2024	316
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 5,375 %, due 5/1/2025	227
Southern Copper Corp, 8,875 %, due 7/15/2023	221
Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,750 %, due 9/30/2024	207
CSC Holdings LLC, 5,375 % due 7/15/2023	203
NBK SPC Ltd, 5,375 %, due 5/15/2024	200
Schaeffler Holding Finance BV, 5,500 % due 8/15/2026	200
Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, due 11/14/2024	193
MGM Resorts International, 6,000 % due 3/15/2023	181
Fly Leasing Ltd, 6,500 %, due 9/15/2024	170
Censis Technologies Inc09/28/2022 Tl, 0,000 %, fällig am 9/28/2022	167
Sprint Corp, 7,125 %, due 6/15/2024	166
Freeport-McMoRan Inc, 6,875 %, due 2/15/2023	158
HCA Inc, 5,375 %, due 2/1/2025	152
Frontera Energy Corp, 7,000 %, due 10/1/2024	146
RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc., 8,250 %, fällig am 5/1/2023	139
Albertson's LLC 07/08/26 Tl, 5,234 %, fällig am 8/7/2026	138
Centene Corp, 4,750 %, due 1/15/2025	124
Cogent Communications Group Inc, 144A, 5,375 %, due 3/1/2022	123
Iron Mountain Inc, 6,000 %, due 8/15/2023	123
Speedway Motorsports Inc., 5,125 %, fällig am 2/1/2023	121
The Gap Inc, 6,875 %, due 3/15/2022	120
Petsmart Inc, 6,380 %, due 3/11/2022	118
Petsmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022	109
Sprint Corp, 4,875 %, due 12/15/2023	104
MPT Oper Partnersp/Finl, 5,500 %, fällig am 5/1/2024	103
XPO Logistics Inc, 6,125 %, due 9/1/2023	103
World Triathlon Corp 12/08/26 Tl, 6,445 %, Due 8/12/2026	70
Beta Sub LLC 24/05/26 Tl, 6,729 %, fällig am 5/24/2026	69
Panther Bf Aggregator 2 LP 18/03/26 Tl, 5,734 %, fällig am 3/18/2026	59

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, due 2/15/2024	323
Altice France SA/France, Serie Regs, 6,250 %, fällig am 5/15/2024	258
Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 4,500 %, due 3/15/2023	253
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,000 %, due 3/1/2023	219
Altice Luxembourg SA, 7,250 %, due 5/15/2022	204
Freeport-McMoRan Inc, 6,875 %, due 2/15/2023	200
CSC Holdings LLC, 8,240 % due 5/16/2024	192
MGM Resorts International, 7.750 % due 3/15/2022	187
Carrols Restaurant Group Inc, 8,000 %, due 5/1/2022	163
HCA Inc, 7,500 %, due 2/15/2022	155
Chesapeake Energy Corp, 5,750 %, due 3/15/2023	149
Petsmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022	144
Albertson's LLC, 5,479 %, due 6/22/2023	139
Scientific Games International Inc, 10,000 %, due 12/1/2022	139
KCA Deutag UK Finance Plc, 9,875 %, fällig am 4/1/2022	137
ServiceMaster Co LLC/The, 144A, 7,450 %, due 8/15/2027	132
Entertainment One Ltd, 4,750 %, due 1/15/2022	132
Hertz Corp/The, 5,875 %, due 10/15/2020	130
Pactiv LLC, 7,125 %, due 12/15/2021	128
Petsmart Inc, 6,380 %, due 3/11/2022	127
Endo Finance LLC / Endo Finco Inc, 144A, 5,375 %, due 1/15/2023	126
Centene Corp, 4,750 %, due 5/15/2022	123
Iron Mountain Inc, 6,000 %, due 8/15/2023	123
Gerdau Trade Inc, 6,875 % due 1/15/2023	120
Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 9,250 %, due 5/15/2023	116
HCA Inc, 5,625 %, due 9/1/2028	109
ArcelorMittal, 6,250 % due 2/25/2022	108
Sprint Corp, 8,375 %, due 1/15/2021	107
XPO Logistics Inc, 6,125 %, due 9/1/2023	106

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

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

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 6,375 %, due 3/1/2024	105
XPO Logistics Inc, 6,500 %, due 6/15/2022	104
MPT Oper Partnersp/Finl, 5,500 %, due 5/1/2024	103
NVA Holdings Inc/United States, 6,875 %, due 4/1/2026	99
HCA Inc, 5,500 %, due 6/15/2047	96
Carrizo Oil & Gas Inc, 8,250 %, due 7/15/2025	94
Brink's Co/The, 4,625 %, due 10/15/2027	92
First Data Corp, 4,490 %, due 4/26/2024	91
Allison Transmission Inc, 5,000 %, due 10/1/2024	90
BWAY Corp, 6,032 %, due 3/23/2024	86
TransUnion LLC, 4,493 %, due 4/9/2023	86
Time Warner Cable LLC, 8,250 %, due 4/1/2019	80

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6211, 7,000 %, due 1/25/2023	9.882
Indonesia Treasury Bond, Series FR78, 8,250 %, due 5/15/2029	8.274
Poland Government Bond, 2,750 %, due 4/25/2028	7.105
Turkey Government International Bond, 7,250 %, due 12/23/2023	3.356
Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, due 2/1/2046	2.515
YPF Sociedad Anonima, 8,500 %, due 3/23/2021	2.440
Petsmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022	2.117
Lecta SA, 6,500 %, due 8/1/2023	1.841
MEG Energy Corp, 144A, 7,000 %, due 3/31/2024	1.660
Targa Resources Partners, 5,875 %, due 4/15/2026	1.610
Trivium Packaging Finance BV, 5,500 %, due 8/15/2026	1.510
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, due 11/15/2048	1.140
Hilton Worldwide Finance LLC, 4,016 %, due 6/21/2026	1.124
Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, due 3/15/2022	1.119
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, due 3/1/2026	1.010
Ukraine Government, 6,750 %, due 6/20/2026	970
Albertson's LLC, 5,234 %, due 8/7/2026	952
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	895
GVC Holdings Plc, 4,023 %, due 3/16/2024	847
Barclays Plc, 7,125 %, Perpetual	787
Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000 %, Perpetual	702
Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, due 8/15/2029	689
Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset US High Yield Fund	625

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6207, 8,150 %, due 2/3/2027	10.186
Indonesia Government International Bond, 5,250 %, due 1/17/2042	9.239
Poland Government Bond, 2,750 %, due 4/25/2028	7.341
RETL 2018-RVP, Series 2018 RVP, Class F, 144A, 8,489 %, due 3/15/2033	6.555
Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Euro High Yield Fund	5.594
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 10/31/2023	5.263
Unibail-Rodamco SE, 2,125 %, Perpetual	3.267
DAE Funding LLC, 144A, 5,750 %, due 11/15/2023	3.255
Koninklijke KPN NV, 7,000 %, due 3/28/2073	2.630
Telefonica Europe BV, 5,875 %, Perpetual	2.519
Virgin Media Secured Finance Plc, 5,500 %, due 1/15/2025	2.518
Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, due 2/1/2046	2.515
Transportadora de Gas Internacional SA ESP, 5,550 %, due 11/1/2028	2.449
Europcar Mobility Group, 5,750 %, due 6/15/2022	2.446
YPF SA, 8,500 %, due 3/23/2021	2.440
Petsmart Inc, 5,520 %, due 3/11/2022	2.249
YPF Sociedad Anonima, 8,500 %, due 3/23/2021	2.230
Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, due 7/15/2045	2.056
Petsmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022	2.038
RETL 2018-RVP, Series 2018 RVP, Class G, 144A, 9,989 %, due 3/15/2033	2.018
Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset US High Yield Fund	2.000
KCA Deutag UK Finance Plc, 144A, 7,250 %, due 5/15/2021	1.980
Ecopetrol SA, 4,125 %, due 1/16/2025	1.811
Vantiv LLC / Vantiv Issuer Corp, 144A, 4,375 %, due 11/15/2025	1.810
Turkey Government International Bond, 7,250 %, due 12/23/2023	1.770
KazMunayGas National Co JSC, 6,375 %, due 10/24/2048	1.737
Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, due 4/15/2025	1.705
Taylor Morrison Communities Inc / Taylor Morrison Holdings II Inc, 144A, 5,250 %, due 4/15/2021	1.700
Targa Resources Partners, 5,875 %, due 4/15/2026	1.682
Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, due 7/13/2044	1.657
Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 5,875 %, due 4/15/2026	1.610
Carrizo Oil & Gas Inc, 6,250 %, due 4/15/2023	1.590
Allergan Funding SCS, 4,850 %, due 6/15/2044	1.262

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	65.141
Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, due 4/1/2026	1.522
Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, due 9/15/2024	1.399
United Rentals North America Inc, 5,250 %, due 1/15/2030	1.258
Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,875 %, due 4/15/2026	1.122
Petsmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022	1.118
Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, due 5/15/2029	986
Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, due 7/15/2026	868
GEO Group Inc/The, 6,000 %, due 4/15/2026	832
Altice Luxembourg SA, 144A, 10,500 %, due 5/15/2027	815
U.S. Renal Care Inc, 7,250 %, due 6/14/2026	794
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, due 3/1/2026	753
Barclays Plc, 5,088 %, due 6/20/2030	750
Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 4,875 %, due 1/15/2030	750
Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, due 5/15/2028	725
CIT Group Inc, 4,750 %, due 2/16/2024	696
PetSmart Inc, Variable Rate, due 3/11/2022	660
Ceoc LLC, 4,234 %, due 10/6/2024	649
Allied Universal Holdco LLC, 6,507 %, due 7/12/2026	601
United Rentals North America Inc, 6,500 %, due 12/15/2026	586

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	59.057
Hilton Worldwide Finance Llc, 4,875 %, due 4/1/2027	1.271
Bioscrip Inc, 8,233 %, due 6/30/2022	954
Valeant Pharmaceuticals International Inc, 8,500 %, due 1/31/2027	829
Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, due 4/15/2025	821
Oasis Petroleum Inc, 6,250 %, due 5/1/2026	816
Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,875 %, due 4/15/2026	779
Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 4,875 %, due 1/15/2030	770
Targa Resources Partners LP, 144A, 5,875 %, due 4/15/2026	748
Diamondback Energy Inc, 5,375 %, due 5/31/2025	734
NGPL PipeCo LLC, 144A, 4,875 %, due 8/15/2027	731
PetSmart Inc, Variable Rate, due 3/11/2022	709
Petsmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022	709
Park Aerospace Holdings Ltd, 5,500 %, due 2/15/2024	679
Berry Global Inc, 4,500 %, due 2/15/2026	672
Carrols Restaurant Group Inc, 8,000 %, due 5/1/2022	664
HCA Inc, 5,500 %, due 6/15/2047	637
Neovia Logistics Services Llc, 8,875 %, due 8/1/2020	620
KCA Deutag UK Finance Plc, 7,250 %, due 5/15/2021	617
NVA Holdings Inc/United States, 6,875 %, due 4/1/2026	595

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Qatar Government International Bond, 4,817 %, due 3/14/2049	370
Bahrain Government International Bond, 6,750 %, due 9/20/2029	213
Republic of Kenya Government International Bond, 8,000 %, due 5/22/2032	210
El Salvador Government International Bond, 7,125 %, due 1/20/2050	200
Banco Mercantil del Norte, 7,500 %, Perpetual	200
UniCredit SpA, 7,296 %, due 4/2/2034	200
Millicom International Cellular SA, 6,250 %, due 3/25/2029	200
Oman Government International Bond, 6,000 %, due 8/1/2029	200
Republic of Turkey Government International Bond, 6,350 %, due 8/10/2024	199
United Overseas Bank Ltd, 3,750 %, due 4/15/2029	199
Radiant Access Ltd, 4,600 %, Perpetual	181
Petrobras Global Finance, 6,900 %, due 3/19/2049	160
Argentine Republic Government International Bond, 7,500 %, due 4/22/2026	131
Egypt Treasury Bills, zero coupon, due 1/21/2020	74
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, due 1/1/2025	70
Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US$ Distributing (M)	54
Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER, 4,000 %, due 3/6/2020	2

WICHTIGE VERKÄUFE	(in Tsd.) USD
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 5,230 %, due 11/15/2021	483
Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US$ Distributing (M)	473
Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375 %, due 3/15/2034	282
Transportadora de Gas del Sur SA, 6,750 %, due 5/2/2025	274
Braskem Finance Ltd, 6,450 %, due 2/3/2024	218
Angolan Government International Bond, 9,375 %, due 5/8/2048	216
Lukoil International Finance BV, 6,656 %, due 6/7/2022	214
Ecuador Government International Bond, 10.750 %, due 1/31/2029	214
Qatar Government International Bond, 5,103 %, due 4/23/2048	213
Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 5,350 %, due 3/11/2024	213
Pertamina Persero PT, 4,875 %, due 5/3/2022	212
Republic of Kenya Government International Bond, 8,000 %, due 5/22/2032	212
NTPC Ltd, 5,625 %, due 7/14/2021	210
CNAC HK Finbridge Co Ltd, 4,625 %, due 3/14/2023	207
Republic of Armenia International Bond, 6,000 %, due 9/30/2020	206
Egypt Government International Bond, 8,700 %, due 3/1/2049	205
Banco Nacional de Costa Rica, 5,875 %, due 4/25/2021	203
Banco Mercantil del Norte, 7,500 %, Perpetual	202
Southern Copper Corp, 3,500 %, due 11/8/2022	202
El Salvador Government International Bond, 7,125 %, due 1/20/2050	201
Republic of Turkey Government International Bond, 6,350 %, due 8/10/2024	201
Banco Nacional de Comercio Exterior SNC/Cayman Islands, 4,375 %, due 10/14/2025	198
Petroleos del Peru SA, 4,750 %, due 6/19/2032	197
Perusahaan Listrik Negara PT, 4,125 %, due 5/15/2027	196
Uruguay Government International Bond, 9,875 %, due 6/20/2022	191
Ivory Coast Government International Bond, 6,125 %, due 6/15/2033	185
Petrobras Global Finance, 6,900 %, due 3/19/2049	161
Egypt Treasury Bills, Series 273D, zero coupon, due 4/23/2019	151
Argentine Republic Government International Bond, 6,875 %, due 1/26/2027	142
Genneia SA, 8,750 %, due 1/20/2022	140
General Electric Co, 3,150 %, due 9/7/2022	124
Argentine Republic Government International Bond, 7,125 %, due 6/28/2117	70

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 4,250 %, due 5/7/2029	700
Petrobras Global Finance BV, 6,900 %, due 3/19/2049	530
Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, due 8/8/2024	490
Usiminas International, 5,875 %, due 7/18/2026	394
Republic of Kenya, 8,000 %, due 5/22/2032	390
United Overseas Bank Ltd, 3,750 %, due 4/15/2029	299
Unicredit Spa, Variable Rate, due 4/2/2034	260
CNOOC Curtis Funding No 1 Pty Ltd, 4,500 %, due 10/3/2023	210
Suzano Austria GmbH, 6,000 %, due 1/15/2029	208
Suzano Austria GmbH, 6,000 %, due 1/15/2029	208
Kenya Government International Bond, 6,875 %, due 6/24/2024	207
Gerdau Trade Inc, 4,875 %, due 10/24/2027	204
Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 7,500 %, Perpetual	200
El Salvador Government International Bond, 7,125 %, due 1/20/2050	200
Consorcio Transmantaro SA, 4,700 %, due 4/16/2034	200
MGM China Holdings Ltd, 5,375 %, due 5/15/2024	200
MGM China Holdings Ltd, 5,875 %, due 5/15/2026	200
Millicom International Cellular SA, 6,250 %, due 3/25/2029	200
Republic of Ghana, 8,950 %, due 3/26/2051	200
State of Qatar, 4,817 %, due 3/14/2049	200
ICICI Bank Ltd/Dubai, 4,000 %, due 3/18/2026	199
MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC, 4,100 %, due 4/11/2023	196
Tencent Holdings Ltd, 3,925 %, due 1/19/2038	189
Egypt Treasury Bills, zero coupon, due 1/21/2020	140

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Usiminas International, 5,875 %, due 7/18/2026	399
Republic of Kenya, 8,000 %, due 5/22/2032	394
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 6,125 %, Perpetual	372
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 4,250 %, due 5/7/2029	354
Unicredit Spa, Variable Rate, 4/2/2034	286
Petrobras Global Finance BV, 4,375 %, due 5/20/2023	284
Petrobras Global Finance BV, 6,900 %, due 3/19/2049	251
Petroleos del Peru SA, 5,625 %, due 6/19/2047	236
Ecopetrol SA, 5,375 %, due 6/26/2026	223
Eskom Holdings SOC Ltd, 6,350 %, due 8/10/2028	216
Honduras Government International Bond, 8,750 %, due 12/16/2020	214
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd, 3,625 %, due 4/12/2027	213
State Bank of India/London, 4,375 %, due 1/24/2024	213
Rumo Luxembourg Sarl, 5,875 %, due 1/18/2025	211
Centrais Eletricas Brasileiras SA, 5,750 %, due 10/27/2021	209
Suzano Trading Ltd, 5,875 %, due 1/23/2021	208
Suzano Austria GmbH, Series JAN, 6,000 %, due 1/15/2029	208
Suzano Austria GmbH, Series JAN, 6,000 %, due 1/15/2029	208
Millicom International Cellular SA, 6,000 %, due 3/15/2025	208
Millicom International Cellular SA, 5,125 %, due 1/15/2028	207
UBS Group Funding Switzerland AG, 7,000 %, Perpetual	207
Turkey Government International Bond, 7,000 %, due 6/5/2020	204
State of Qatar, 4,817 %, due 3/14/2049	203
Borets Finance DAC, 6,500 %, due 4/7/2022	202
MGM China Holdings Ltd, 5,875 %, due 5/15/2026	202
ICICI Bank Ltd/Dubai, 3,250 %, due 9/9/2022	201
Republic of Ghana, 8,950 %, due 3/26/2051	201
Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 5,750 %, due 10/4/2031	196
Coca-Cola Icecek AS, 4,215 %, due 9/19/2024	192
Teva Pharmaceutical Finance IV BV, 3,650 %, due 11/10/2021	184
Transportadora de Gas del Sur SA, 6,750 %, due 5/2/2025	181
Puma International Financing SA, 5,000 %, due 1/24/2026	175
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,875 %, due 1/16/2024	163
Egypt Treasury Bills, Series 273D, zero coupon, due 4/23/2019	157
Genneia SA, 8,750 %, due 1/20/2022	140

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	2.692
PetSmart Inc, 5,480 %, due 3/11/2022	2.059
Petsmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022	1.773
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,903 %, due 2/1/2024	1.527
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 3/31/2022	1.484
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, due 7/21/2023	1.421
Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, due 4/1/2026	1.355
United States Treasury Note/Bond , 2,500 %, due 1/31/2021	1.253
Republic of Poland Government Bond, Series 0727, 2,500 %, due 7/25/2027	1.228
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, due 5/31/2021	1.187
Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, due 3/15/2043	981
Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, due 5/15/2029	970
Maxeda DIY Holding BV, 6,125 %, due 7/15/2022	951
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 11/30/2021	898
Brazilian Government International Bond, 4,250 %, due 1/7/2025	896
Argentine Republic Government International Bond, 6,875 %, due 4/22/2021	881
Magellan Health Inc, 4,900 %, due 9/22/2024	826
Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, due 12/18/2022	702
United States Treasury Note/Bond , 1,375 %, due 4/30/2021	693
Charter Communications Operating LLC, 4,330 %, due 4/30/2025	692
Saga Plc, 3,375 %, due 5/12/2024	620
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, due 5/15/2022	604
Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,875 %, due 4/15/2026	603
UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, due 4/2/2034	590
Western Midstream Operating LP, 4,650 %, due 7/1/2026	561
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 7/31/2021	501
Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, due 11/14/2024	500
Global Air Lease Co Ltd, 6,500 %, due 9/15/2024	480

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	5.890
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 3/31/2022	2.967
Petsmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022	2.205
PetSmart Inc, 5,480 %, due 3/11/2022	2.138
Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, due 5/1/2026	1.899
Altice Luxembourg SA, 144A, 7,750 %, due 5/15/2022	1.842
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, due 5/31/2023	1.460
Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, due 2/1/2029	1.428
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,000 %, due 2/1/2028	1.397
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, due 8/31/2022	1.385
Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, due 4/15/2025	1.370
United States Treasury Note/Bond , 2,500 %, due 1/31/2021	1.264
Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, due 11/14/2024	1.150
Citigroup Inc, Series P, 5,950 %, Perpetual	975
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,000 %, due 2/15/2021	785
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, due 4/30/2021	696
BioScrip Inc, 8,234 %, due 6/30/2022	690
Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, due 4/1/2026	644
American Axle & Manufacturing Inc, 6,500 %, due 4/1/2027	636
Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, due 5/15/2029	633

Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	1.272
United States Treasury Floating Rate Note, zero coupon, due 4/2/2019	585
United States Treasury Floating Rate Note, zero coupon, due 6/13/2019	354
United States Treasury Floating Rate Note, zero coupon, due 4/30/2019	349
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 5/13/2019	325

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	1.289
United States Treasury Floating Rate Note, 2,465 %, due 10/31/2020	1.198
United States Treasury Floating Rate Note, 2,453 %, due 4/30/2020	1.094
United States Treasury Floating Rate Note, 2,540 %, due 1/31/2021	749
United States Treasury Floating Rate Note, zero coupon, due 4/02/2019	586
Federal Farm Credit Banks, 2,617 %, due 10/29/2020	500
United States Treasury Floating Rate Note, 2,473 %, due 10/31/2019	500
United States Treasury Floating Rate Note, 2,468 %, due 7/31/2020	499
United States Treasury Floating Rate Note, zero coupon, due 6/13/2019	355
United States Treasury Floating Rate Note, zero coupon, due 4/30/2019	350
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, due 5/13/2019	325
Berkshire Hathaway Finance Corp, 3,478 %, due 3/15/2019	250
Exxon Mobil Corp, 2,938 %, due 3/15/2019	250
Capital One Multi-Asset Execution Trust, Series 2016 A3, Class A3, 1,340 %, due 4/15/2022	100
United States Treasury Bill, zero coupon, due 3/14/2019	70
Freddie Mac Non Gold Pool '555464', 10,500 %, fällig am 12/1/2020	2

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

WICHTIGE KÄUFE	(in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	5.260
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 3,875 %, due 4/15/2029	1.147
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, due 4/15/2024	1.137
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, due 1/15/2028	1.077
Spain Government Inflation Linked Bond, 144A, 0,700 %, due 11/30/2033	653
Spain Government Bond, Series 30Y, 144A, 2,700 %, due 10/31/2048	614
Mexico Government International Bond, 2,875 %, due 4/8/2039	587
Qatar Government International Bond, 5,103 %, due 4/23/2048	459
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 2,550 %, due 9/15/2041	413
State of Qatar, 4,000 %, due 3/14/2019	379
United Kingdom Gilt Inflation Linked, Series 3MO, 0,125 %, due 3/22/2068	184
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, due 7/15/2025	93
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, due 4/15/2021	90
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, due 1/15/2027	77
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, due 1/15/2023	57
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, due 7/15/2023	50
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 3,100 %, due 9/15/2026	37
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, due 4/15/2020	36
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Series I/L, 1,750 %, due 4/15/2020	31
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, due 1/15/2026	26

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, due 4/15/2020	5.822
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	4.675
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, due 4/15/2021	2.633
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Series I/L, 1,750 %, due 4/15/2020	1.527
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, due 4/15/2019	515
State of Qatar, 4,000 %, due 3/14/2019	414
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 3,100 %, due 9/15/2026	21
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,850 %, due 7/25/2027	13
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 0,250 %, due 7/25/2024	11
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,100 %, due 7/25/2022	6
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 0,100 %, due 5/15/2023	6
Japanese Government CPI Linked Bond, Series 20, 0,100 %, due 3/10/2025	4
Japanese Government CPI Linked Bond, Series 23, 0,100 %, due 3/10/2028	3
Canadian Government Real Return Bond, Series CPI, 4,250 %, due 12/1/2026	1
Canadian Government Real Return Bond, Series CPI, 4,250 %, due 12/1/2021	1
Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21, 0,100 %, due 3/10/2026	1
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, due 7/15/2025	1
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, due 1/15/2027	–
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, due 1/15/2023	–
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, due 7/15/2023	–

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	97.173
United States Treasury Bill, zero coupon, due 9/17/2019	14.953
India Government Bond, 7,610 %, due 5/9/2030	14.608
European Investment Bank, 7,400 %, due 1/24/2022	14.215
Monetary Authority of Singapore Bill, Series 84, zero coupon, due 5/31/2019	9.913
US Treasury Bill, zero coupon, due 9/10/2019	7.475
Credit Agricole SA, 3,800 %, due 4/30/2031	7.341
Malaysia Government Bond, Series 0419, 3,828 %, due 7/5/2034	5.106
Coastal Emerald Ltd, 4,300 %, Perpetual	4.998
Bank Mandiri Persero Tbk PT, 3,750 %, due 4/11/2024	3.762
China Minmetals Corp, 3,750 %, Perpetual	3.071
Shimao Property Holdings Ltd, 5,750 %, due 3/15/2021	3.023
India Government Bond, 6,570 %, due 12/5/2033	2.315
Jasa Marga Persero Tbk PT, 7,500 %, due 12/11/2020	1.721
Bank of China Ltd/Macau, 3,300 %, due 4/17/2022	1.340
United Overseas Bank Ltd, 3,750 %, due 4/15/2029	997
Daimler International Finance BV, 3,780 %, due 3/22/2022	895
Export-Import Bank of China/The, 4,400 %, due 5/14/2024	773

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	97.260
India Government Bond, 8,150 %, due 6/11/2022	14.576
Indonesia Treasury Bond, Series FR70, 8,375 %, due 3/15/2024	12.682
Monetary Authority of Singapore Bill, Series 84, zero coupon, due 5/31/2019	9.898
Monetary Authority of Singapore Bill, Series 84, zero coupon, due 3/8/2019	9.712
US Treasury Bill, zero coupon, due 9/10/2019	7.486
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, due 3/31/2019	7.000
Monetary Authority of Singapore Bill, Series 84, zero coupon, due 3/15/2019	5.175
Eastern Creation II Investment Holdings Ltd, 4,150 %, due 12/4/2021	5.131
Bank of China Ltd/Macau, 4,450 %, due 3/5/2019	3.877
Taiwan Government Bond, 2,375 %, due 2/25/2025	3.490
China Government Bond, 3,280 %, due 6/2/2019	3.317
Taiwan Government Bond, Series 99-5, 1,375 %, due 3/10/2020	3.266
Toyota Astra Financial Services PT, Series OB, 8,400 %, due 6/1/2019	2.312
Indonesia Treasury Bond, Series FR77, 8,125 %, due 5/15/2024	2.216
Standard Chartered Bank, 4,560 %, due 4/15/2019	2.087
Far East Horizon Ltd, 4,375 %, due 2/27/2023	2.014
United States Treasury Bill, zero coupon, due 9/17/2019	1.996
Taiwan Government Bond, Series 99-4, 1,875 %, due 2/22/2030	1.795
Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 5,250 %, due 4/30/2022	1.544

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund*

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	70.271
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 3/31/2024	23.673
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 3/31/2022	8.502
Enexis Holding NV, 0,750 %, due 7/2/2031	3.517
Bank of Nova Scotia/The, 0,500 %, due 4/30/2024	2.486
United Parcel Service Inc, 1,625 %, due 11/15/2025	2.416
Toronto-Dominion Bank/The, 0,375 %, due 4/25/2024	2.374
Nuveen LLC, 4,000 %, due 11/1/2028	2.119
Verizon Communications Inc, 4,329 %, due 9/21/2028	2.099
Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 2,900 %, due 7/26/2024	1.995
Goldman Sachs Group Inc/The, 0,125 %, due 8/19/2024	1.939
Walmart Inc, 3,250 %, due 7/8/2029	1.901
UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, due 7/15/2025	1.889
Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625 %, due 1/22/2023	1.858
JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, due 12/5/2024	1.745
Boeing Co/The, 3,100 %, due 5/1/2026	1.744
Waste Management Inc, 3,500 %, due 5/15/2024	1.740
AT&T Inc, 3,400 %, due 5/15/2025	1.739
Bank of America Corp, 3,550 %, due 3/5/2024	1.733
HSBC Holdings Plc, 3,803 %, due 3/11/2025	1.732

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	57.680
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 3/31/2024	12.207
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 11/15/2027	2.098
Boeing Co/The, 6,000 %, due 3/15/2019	577
Medtronic Inc, 3,125 %, due 3/15/2022	576
GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 2,342 %, due 11/15/2020	508
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,500 %, due 2/15/2023	449
John Deere Capital Corp, 2,250 %, due 4/17/2019	343
Morgan Stanley, 7,300 %, due 5/13/2019	240
Telstra Corp Ltd, 1,375 %, due 3/26/2029	126

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	44.902
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 8/15/2045	8.630
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, due 4/15/2024	8.051
Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Clase M	7.917
Republic of Poland Government Bond, Series 0428, 2,750 %, due 4/25/2028	7.644
United States Treasury Bond, 2,250 %, due 8/15/2027	4.919
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250 %, due 9/1/2046	4.351
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	4.134
Freddie Mac Pool 'SD7504', 3,500 %, due 8/1/2049	4.052
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	4.013
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	3.992
United States Treasury Bond, 2,125 %, due 5/31/2026	3.872
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 %	3.552
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 4,500 %	3.211
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	2.996
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	2.884
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	2.879
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	2.860
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	2.749
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	2.737
Norway Government Bond, Series 481, 144A, 1,750 %, due 9/6/2029	2.625
Ginnie Mae II Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	2.584

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	51.305
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 8/15/2045	8.602
United States Treasury Bond, 2,000 %, due 10/31/2022	7.209
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,000 %, due 12/1/2025	6.648
United States Treasury Bond, 1,625 %, due 5/15/2026	5.605
United States Treasury Bond, 2,250 %, due 8/15/2027	4.918
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 3/31/2022	4.549
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,000 %	4.158
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	4.013
Fannie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	3.999
United States Treasury Bond, 2,125 %, due 5/31/2026	3.920
United States Treasury Bond, 1,375 %, due 4/30/2021	3.576
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 12/31/2024	3.273
United States Treasury Bond, 2,125 %, due 3/31/2024	3.235
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, due 8/15/2022	3.224
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 4,500 %	3.211
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	3.034
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	2.896
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	2.887
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	2.881
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	2.759
Ginnie Mae Pool, 30 year, TBA, 3,500 %	2.752
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 %	2.643
Ginnie Mae II Pool 'MA5528', 4,000 %, due 10/20/2048	2.567

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	12.641
United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, due 1/31/2024	3.528
Merck KGAA, 1,625 %, due 6/25/2079	1.446
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007, 4,250 %, due 7/4/2039	896
Anadarko Petroleum Corp, 6,600 %, due 3/15/2046	863
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, due 2/15/2026	823
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, due 2/15/2028	761
Citigroup Inc, 8,125 %, due 7/15/2039	749
Swiss Re Finance Luxembourg SA, 2,534 %, due 4/30/2050	678
CYBG Plc, 4,000 %, due 9/3/2027	612
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, due 2/15/2027	547
JPMorgan Chase & Co, 1,090 %, due 3/11/2027	535
Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, due 2/1/2046	516
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, due 2/15/2029	510
Intesa Sanpaolo SpA, 1,000 %, due 7/4/2024	431
Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, due 10/1/2024	428
Coca-Cola HBC Finance BV, 1,625 %, due 5/14/2031	425
Medtronic Global Holdings, 2,250 %, due 3/7/2039	404
Illinois Tool Works Inc, 0,250 %, due 12/5/2024	399
Boeing Co/The, 3,950 %, due 8/1/2059	367

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	14.164
Merck KGAA, 1,625 %, due 6/25/2079	1.472
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, due 2/15/2028	1.077
United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, due 5/15/2048	949
Citigroup Inc, 4,125 %, due 7/25/2028	602
Vonovia Finance BV, 4,000 %, Perpetual	597
Kraft Heinz Foods Co, 2,250 %, due 5/25/2028	586
Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000 %, due 5/15/2027	564
AT&T Inc, 2,350 %, due 9/5/2029	542
Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, due 3/16/2027	485
Citigroup Inc, 4,450 %, due 9/29/2027	473
KBC Group NV, 4,750 %, Perpetual	462
Coca-Cola HBC Finance BV, 1,625 %, due 5/14/2031	456
Medtronic Global Holdings, 2,250 %, due 3/7/2039	439
Swedbank AB, 1,000 %, due 11/22/2027	405
Telefonica Emisiones Sau, 1,957 %, due 7/1/2039	384
Inmobiliaria Colonial Socimi, 2,000 %, due 4/17/2026	358
CaixaBank SA, 3,500 %, due 2/15/2027	354
Unibail-Rodamco SE, 2,875 %, Perpetual	351
Bundesrepub. Deutschland, 4,000 %, due 1/4/2037	347

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR
Kronos International Inc, 3,750 %, due 9/15/2025	1.306
Galaxy Bidco Ltd, 6,500 %, due 7/31/2026	1.108
Virgin Media Secured Finance Plc, 5,000 %, due 4/15/2027	1.065
ASR Media and Sponsorship SpA, 5,125 %, due 8/1/2024	1.000
Trivium Packaging Finance BV, 3,750 %, due 8/15/2026	1.000
Verisure Holding AB 21/10/22 Tl, 3,000 %, due 10/21/2022	995
Bayer AG, 2,375 %, due 04/02/2075	763
Gvc Holdings Plc 16/03/24 Tl, 4,023 %, due 3/16/2024	734
Ladbrokes Group Finance Plc, 5,125 %, due 9/8/2023	719
Casino Guichard Perrachon SA, 5,976 %, due 5/26/2021	694
Casino Guichard Perrachon SA, 4,498 %, due 3/7/2024	681
Casino Guichard Perrachon SA, 1,865 %, due 6/13/2022	545
Altice Luxembourg SA, 8,000 %, due 5/15/2027	518
Novem Group GmbH, 5,250 %, due 5/15/2024	500
Altice Luxembourg SA, 6,250 %, due 2/15/2025	490
Novafives SAS, 5,000 %, due 6/15/2025	355
Pinnacle Bidco Plc, 6,375 %, due 2/15/2025	347
Europcar Mobility Group, 4,000 %, due 4/30/2026	340
Lecta SA, 6,500 %, due 8/1/2023	169
Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000 %, Perpetual	149
Entertainment One Ltd, 4,625 %, due 7/15/2026	146

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Telefonica Europe BV, 5,875 %, Perpetual	1.799
Virgin Media Secured Finance Plc, 5,500 %, due 1/15/2025	1.602
Vantiv LLC / Vantiv Issuer Corp, 3,875 %, due 11/15/2025	1.508
Galaxy Bidco Ltd, 6,375 %, due 11/15/2020	1.099
Europcar Mobility Group, 5,750 %, due 6/15/2022	1.055
Spectrum Brands Inc, 4,000 %, due 10/1/2026	1.051
Altice Luxembourg SA, 7,250 %, due 5/15/2022	1.045
Alliance Data Systems Corp, 4,500 %, due 3/15/2022	894
Nexi Capital SpA, 4,125 %, due 11/1/2023	894
Swissport Financing Sarl, 6,750 %, due 12/15/2021	827
Verisure Holding AB, 3,500 %, due 5/15/2023	825
Bayer AG, 2,375 %, due 4/2/2075	782
SMCP Group SAS, 5,875 %, due 5/1/2023	765
eircom Finance DAC, 4,500 %, due 5/31/2022	758
GVC Holdings Plc Term Loan, 4,999 %, due 3/15/2024	734
Altice France SA/France, 5,625 %, due 5/15/2024	692
Hanesbrands Finance Luxembourg SCA, 3,500 %, due 6/15/2024	651
Adient Global Holdings Ltd, 3,500 %, due 8/15/2024	575
Casino Guichard Perrachon SA, 4,498 %, due 3/7/2024	542
Piaggio & C SpA, 3,625 %, due 4/30/2025	524
Altice Luxembourg SA, 6,250 %, due 2/15/2025	511
CBR Fashion Finance BV, 5,125 %, due 10/1/2022	507
Adler Pelzer Holding GmbH, 4,125 %, due 4/1/2024	481
Boparan Finance Plc, 5,500 %, due 7/15/2021	467
Vue International Bidco Plc, 7,875 %, due 7/15/2020	424
Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, due 7/13/2044	338
IDH Finance Plc, 6,250 %, due 8/15/2022	312
Unibail-Rodamco SE, 2,125 %, Perpetual	302
Gvc Holdings Plc, 4,023 %, due 3/16/2024	267

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	1.502.118
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, due 5/15/2029	479.600
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 6/15/2022	467.859
United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, due 2/15/2029	384.719
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 5/31/2021	362.470
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	358.000
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 7/15/2022	336.162
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	266.939
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, due 8/31/2026	249.087
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 5/31/2026	226.671
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, due 2/15/2049	225.089
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 8/15/2049	166.768
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 3/31/2026	142.705
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, due 5/31/2024	141.923
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 3/31/2024	131.708
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, due 7/31/2026	128.834
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, due 5/23/2029	119.216
Indonesia Treasury Bond, Series FR78, 8,250 %, due 5/15/2029	117.220
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, due 6/30/2026	105.324
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 6/30/2024	96.631
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050 %, due 1/19/2028	93.608

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	1.561.748
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, due 5/15/2029	479.506
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 6/15/2022	468.363
United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, due 2/15/2029	412.665
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 5/31/2021	362.810
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	359.627
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 7/15/2022	336.589
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 5/15/2047	316.016
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	307.101
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, due 11/15/2040	266.797
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 5/31/2026	226.551
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 8/15/2049	172.239
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 3/31/2026	142.435
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, due 5/31/2024	142.093
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 3/31/2024	131.309
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, due 7/31/2026	117.941
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, due 6/30/2026	105.436
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 6/30/2024	96.618
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,000 %, due 12/1/2025	75.657
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, due 2/15/2049	60.323

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, due 1/1/2029	696
Egypt Treasury Bills, zero coupon, due 1/21/2020	520
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, due 11/13/2042	465
Thailand Government Bond, 3,775 %, due 6/25/2032	397
Philippine Government International Bond, 3,900 %, due 11/26/2022	394
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6211, 7,000 %, due 1/25/2023	284
Czech Republic Government Bond, Series 94, 0,950 %, due 5/15/2030	273
Republic of Argentina, 3,750 %, due 12/31/2038	259
Peru Government Bond, 6,850 %, due 2/12/2042	257
Romania Government Bond, Series 10Y, 5,000 %, due 2/12/2029	247
Malaysia Government Bond, Series 0513, 3,733 %, due 6/15/2028	206
Republic of Ghana, 8,950 %, due 3/26/2051	200
Republic of Kenya, 8,000 %, due 5/22/2032	200
Republic of Senegal, 6,250 %, due 5/23/2033	188
Ukraine Government Bond, 17,250 %, due 9/30/2020	178
Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER, 4,000 %, due 3/6/2020	164
Malaysia Government Bond, Series 0415, 4,254 %, due 5/31/2035	137
Republic of Poland Government Bond, Series 0727, 2,500 %, due 7/25/2027	134
Peru Government Bond, 144A, 6,150 %, due 8/12/2032	98
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6221, 7,700 %, due 3/23/2033	98
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 5,100 %, due 7/15/2050	96
Thailand Government Bond, 3,300 %, due 6/17/2038	95
Republic of South Africa Government Bond, Series R209, 6,250 %, due 3/31/2036	90
Republic of Argentina, 4,625 %, due 01/11/2023	89
Republic of South Africa Government Bond, Series R213, 7,000 %, due 2/28/2031	88
Indonesia Treasury Bond, Series FR78, 8,250 %, due 5/15/2029	87
Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, due 2/28/2041	66

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, due 1/1/2021	903
Turkey Government Bond, 10,500 %, due 8/11/2027	384
Republic of Argentina, 3,750 %, due 12/31/2038	260
Romania Government Bond, Series 7Y, 3,500 %, due 12/19/2022	244
Uruguay Government International Bond, 9,875 %, due 6/20/2022	236
Angolan Government International Bond, 9,500 %, due 11/12/2025	230
Malaysia Government Bond, Series 0112, 3,418 %, due 8/15/2022	226
Hungary Government Bond, Series 31/A, 3,250 %, due 10/22/2031	223
Ecuador Government International Bond, 10.750 %, due 1/31/2029	221
Ghana Government International Bond, 7,875 %, due 8/7/2023	217
Egypt Government International Bond, 7,903 %, due 2/21/2048	209
Dominican Republic International Bond, 7,500 %, due 5/6/2021	207
Egypt Treasury Bills, Series 273D, zero coupon, due 4/23/2019	204
Republic of Kenya, 8,000 %, due 5/22/2032	202
Egypt Treasury Bills, zero coupon, due 1/21/2020	199
Republic of Ghana, 8,950 %, due 3/26/2051	197
Republic of Senegal, 6,250 %, due 5/23/2033	192
Mexican Bonos, Series M, 6,500 %, due 6/9/2022	172
Malaysia Government Bond, Series 0111, 4,160 %, due 7/15/2021	134
Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, due 2/28/2041	126
Colombian TES, Series B, 7,000 %, due 6/30/2032	125
Argentina POM Politica Monetaria, Series POM, 66.777 %, due 6/21/2020	124
Turkey Government Bond, 11,000 %, due 2/24/2027	116
Thailand Government Bond, 3,650 %, due 6/20/2031	96
Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER, 4,000 %, due 3/6/2020	90
Peru Government Bond, 6,850 %, due 2/12/2042	84
Republic of Argentina, 4,625 %, due 1/11/2023	60

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, due 3/15/2020	79.583
United States Treasury Bill, zero coupon, due 2/6/2020	12.595
Fannie Mae Pool 'BM5520', 3,500 %, due 2/1/2047	7.153
Egypt Treasury Bills, Series 273D, zero coupon, due 2/11/2020	5.483
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Class C, 144A, 5,995 %, due 7/15/2034	4.010
CSWF 2018-TOP, Series 2018 TOP, Class D, 144A, 3,995 %, due 8/15/2035	3.683
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-C, Series 2005 C, Class M2, 2,645 %, due 10/25/2035	3.273
PetSmart Inc, 144A, 7,125 %, due 3/15/2023	3.149
Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, due 9/15/2024	2.960
CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144A, 4,373 %, due 9/15/2037	2.913
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144A, 4,544 %, due 8/5/2024	2.751
Montage Resources Corp, 8,875 %, due 7/15/2023	2.723
Kenya Government International Bond, 144A, 7,000 %, due 5/22/2027	2.610
Flatiron Clo 17 Ltd, Series 2017 1A, Class A, 144A, 3,408 %, due 5/15/2030	2.350
Venture XXVI CLO Ltd, Series 2017 26A, Class A, 144A, 3,728 %, due 1/20/2029	2.303
KBC Group NV, 4,750 %, Perpetual	2.235
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class E, 144A, 4,544 %, due 8/5/2024	2.225
Whiting Petroleum Corp, 1,250 %, due 4/1/2020	2.180
Suzano Austria GmbH, 6,000 %, due 1/15/2029	2.175
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, due 4/1/2023	2.153

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, due 3/31/2019	50.000
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, due 3/15/2020	39.702
Williams Cos Inc/The, 8,750 %, due 3/15/2032	4.904
PetSmart Inc, 144A, 5,875 %, due 6/1/2025	3.285
Indonesia Government International Bond, 6,625 %, due 2/17/2037	2.877
BioScrip Inc, 8,875 %, due 2/15/2021	2.845
Suzano Austria GmbH, 144A, 6,000 %, due 1/15/2029	2.175
Whiting Petroleum Corp, 1,250 %, due 4/1/2020	2.160
Yamana Gold Inc, 4,950 %, due 7/15/2024	2.031
RETL 2018-RVP, Series 2018 RVP, Class F, 144A, 8,489 %, due 3/15/2033	2.025
Altice Luxembourg SA, 144A, 7,750 %, due 5/15/2022	2.023
IRB Holding Corp, 5,744 %, due 2/5/2025	1.982
Egypt Treasury Bills, Series 273D, zero coupon, due 6/4/2019	1.969
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, due 7/21/2023	1.895
Scientific Games International Inc, 10.000 %, due 12/1/2022	1.892
GAHR Commercial Mortgage Trust 2015-NRF, Series 2015 NRF, Class EFX, 144A, 3,382 %, due 12/15/2034	1.890
Beacon Roofing Supply Inc, 4,767 %, due 1/2/2025	1.764
Argentine Republic Government International Bond, 7,125 %, due 7/6/2036	1.733
Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875 %, due 4/1/2027	1.727
Avolon TLB Borrower 1 U.S. LLC, 4,480 %, due 1/15/2025	1.723

Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	12.584
Republic of Poland Government Bond, Series 0428, 2,750 %, due 4/25/2028	3.221
Spain Government Bond, Series 30Y, 144A, 2,700 %, due 10/31/2048	2.314
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, due 4/15/2024	1.639
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 11/15/2025	788
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250 %, due 9/1/2046	772
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 2,550 %, due 9/15/2041	626
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	618
Kingdom of Belgium Government Bond, Series 88, 144A, 1,700 %, due 6/22/2050	425
United States Treasury Note/Bond, 8,000 %, due 11/15/2021	423
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, due 8/31/2026	397
Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, due 10/1/2024	315
Saudi Government International Bond, 2,000 %, due 7/9/2039	280
Mexico Government International Bond, 2,875 %, due 4/8/2039	232

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	11.611
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 3/31/2022	5.686
United States Treasury Note/Bond, 8,000 %, due 11/15/2021	2.447
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, due 2/15/2025	2.007
CVS Health Corp, 3,350 %, due 3/9/2021	421
Turkey Government Bond, 10.500 %, due 8/11/2027	253
Vonovia Finance BV, 4,000 %, Perpetual	239
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, due 8/15/2025	215
Mexico Government International Bond, 5,550 %, due 1/21/2045	151
Swedbank AB, 1,000 %, due 11/22/2027	135
Allergan Funding SCS, 2,625 %, due 11/15/2028	127
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, due 11/15/2025	102
Altria Group Inc, 9,250 %, due 8/6/2019	80

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ - (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, due 8/15/2025	176
Medtronic Global Holdings SCA, 1,125 %, due 3/7/2027	169
Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, due 8/15/2029	50
Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, due 2/1/2046	42
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	32
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,850 %, due 7/25/2027	26

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, due 11/30/2022	71
Nelnet Student Loan Trust 2008-3, Series 2008 3, Class A4, 4,301 %, due 11/25/2024	66
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, due 11/15/2023	62
Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, due 2/1/2046	45
Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, due 2/1/2046	42
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,850 %, due 7/25/2027	15
Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21, 0,100 %, due 3/10/2026	4

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	401.763
American Dream 06/29/2024 TI, 11,363 %, due 6/29/2024	29.910
Schron Healthcare Portfolio, due 9/1/2021	22.946
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144A, 4,544 %, due 8/5/2024	14.002
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Class D, 144A, 8,745 %, due 7/15/2034	12.608
EFS Volunteer No 2 LLC, Series 2012 1, Class A2, 144A, 3,495 %, due 3/25/2036	12.165
Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2II, 144A, 4,723 %, due 6/7/2049	12.000
Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2014 1, Class A2, 144A, 4,277 %, due 5/9/2044	11.851
Motel 6 Trust 2017-MTL6, Series 2017 MTL6, Class B, 144A, 3,385 %, due 8/15/2034	11.246
FREMF 2016-K55 Mortgage Trust, Series 2016 K55, Class B, 144A, 4,296 %, due 4/25/2049	10.633
Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, Series 2019 DNA1, Class B2, 144A, 13,016 %, due 1/25/2049	10.462
CHT 2017-COSMO Mortgage Trust, Series 2017 CSMO, Class B, 144A, 3,595 %, due 11/15/2036	10.260
Connecticut Avenue Securities Trust 2018-R07, Series 2018 R07, Class 1M2, 144A, 4,545 %, due 4/25/2031	10.140
BX Trust 2018-MCSF, Series 2018 MCSF, Class D, 144A, 3,648 %, due 4/15/2035	10.000
SLM Student Loan Trust 2004-10, Series 2004 10, Class B, 2,646 %, due 1/25/2040	8.701
FREMF 2015-K49 Mortgage Trust, Series 2015 K49, Class B, 144A, 3,848 %, due 10/25/2048	8.228
Ashford Hospitality Trust 2018-KEYS, Series 2018 KEYS, Class C, 144A, 3,795 %, due 5/15/2035	8.015
Palmetto Skilled Nursing 01/11/2022 Term Loan, 6,470 %, due 1/11/2022	8.000
Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Series RFC 2007-HE1, Series 2007 HE1, Class A4, 2,285 %, due 12/25/2036	7.991
FREMF 2018-K732 Mortgage Trust, Series 2018 K732, Class B, 144A, 4,194 %, due 5/25/2025	7.854

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	289.981
Schron Healthcare Portfolio, due 9/1/2021	23.000
RETL 2018-RVP, Series 2018 RVP, Class F, 144A, 8,489 %, due 3/15/2033	19.868
LSTAR Securities Investment Ltd 2017-8R, Series 2017 8R, Class A, 144A, 5,014 %, due 11/5/2022	13.014
Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2014 1, Class A2, 144A, 4,277 %, due 5/9/2044	11.850
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2014-FL1, Series 2014 FL1, Class E, 144A, 4,348 %, due 12/15/2031	11.200
BX Trust 2017-IMC, Series 2017 IMC, Class G, 144A, 7,989 %, due 10/15/2032	8.130
Waldorf Astoria Boca Raton Trust 2016-BOCA, Series 2016 BOCA, Class F, 144A, 7,989 %, due 6/15/2029	6.500
GAHR Commercial Mortgage Trust 2015-NRF, Series 2015 NRF, Class GFX, 144A, 3,382 %, due 12/15/2034	5.856
CSMC 2016-MFF, Series 2016 MFF, Class E, 144A, 8,489 %, due 11/15/2033	5.760
RETL 2018-RVP, Series 2018 RVP, Class G, 144A, 9,989 %, due 3/15/2033	4.800
Nationstar Home Equity Loan Trust 2007-A, Series 2007 A, Class M3, 2,790 %, due 3/25/2037	4.059
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR4 Trust, Series 2006 AR4, Class 1AC3, 2,764 %, due 5/25/2046	3.577
Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series 2007-C33, Series 2007 C33, Class AJ, 5,844 %, due 2/15/2051	3.100
HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Series 2006 10, Class 2A1B, 2,422 %, due 11/19/2036	1.804
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-MAR7, Series 2015 MAR7, Class E, 144A, 5,962 %, due 6/5/2032	1.500
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-CIBC18, Series 2007 CB18, Class AJ, 5,502 %, due 6/12/2047	1.438
Impac Secured Assets Trust 2006-3, Series 2006 3, Class A1, 2,315 %, due 11/25/2036	1.430
FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Series 2018 SB48, Class B, 144A, 3,677 %, due 2/25/2038	1.240
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, Series 2005 AR17, Class A1C4, 2,890 %, due 12/25/2045	1.088

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	118.721
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500 %	61.373
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500 %	37.679
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500 %	30.386
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,000 %	26.211
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 %	23.321
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500 %	23.203
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500 %	23.195
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 %	20.278
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,000 %	19.955
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,000 %	19.150
Fannie Mae, 30 year, 3,500 %, due 6/1/2049	16.888
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500 %	14.948
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,500 %	14.536
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,000 %	13.673
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,000 %	13.653
Freddie Mac Pool 'ZS4790', 4,000 %, due 9/1/2048	12.842
Ginnie Mae II, 30 year, 4,000 %, due 10/20/2048	12.795
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500 %	12.773
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500 %	11.046
Freddie Mac Pool 'ZS4758', 3,000 %, due 3/1/2048	10.671
Fannie Mae, 30 year, 4,000 %, due 1/10/2049	10.617

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	95.385
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500 %	61.473
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500 %	37.775
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500 %	30.395
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,000 %	26.344
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500 %	23.312
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500 %	23.289
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500 %	23.201
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,000 %	19.982
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,000 %	19.161
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,000 %	17.983
Fannie Mae, 30 year, 3,500 %, due 6/1/2049	16.984
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500 %	14.943
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,500 %	14.548
Fannie Mae Pool 'AE7744', 4,500 %, due 11/1/2040	13.834
Freddie Mac, 30 year, 4,000 %, due 8/1/2048	13.730
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,000 %	13.677
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,000 %	13.516
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500 %	12.808
Ginnie Mae II, 30 year, 4,000 %, due 10/20/2048	12.803
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 %	11.478
Freddie Mac, 30 year, 3,000 %, due 3/1/2048	11.052
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,000 %	10.613
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 %	10.448
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 %	10.210

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^*

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	32.408
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, due 5/15/2029	6.205
United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, due 2/15/2029	2.084
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	1.983
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 7/31/2024	1.782
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200 %, due 7/21/2021	1.413
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 6/30/2024	1.274
Boeing Co/The, 3,100 %, due 5/1/2026	1.228
Danske Bank A/S, 144A, 5,000 %, due 1/12/2022	1.201
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 3/31/2024	922
UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, due 4/2/2034	914
UniCredit SpA, 144A, 6,572 %, due 1/14/2022	850
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, due 11/15/2048	825
Vinci SA, 3,750 %, due 4/10/2029	823
Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 3,400 %, due 7/26/2029	757
Intesa Sanpaolo SpA, Series 0000, 144A, 6,500 %, due 2/24/2021	743
Barclays Plc, 5,088 %, due 6/20/2030	685
Global Payments Inc, 2,650 %, due 2/15/2025	660
Royal Bank of Scotland Group Plc, 8,625 %, Perpetual	636
American Express Co, 2,500 %, due 7/30/2024	618

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	33.025
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, due 5/15/2029	3.260
United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, due 2/15/2029	2.689
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, due 11/15/2048	1.533
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 7/31/2024	1.395
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 8/15/2048	1.350
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, due 6/30/2024	1.276
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	1.147
Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,750 %, due 1/23/2029	1.131
Teva Pharmaceutical Finance IV LLC, 2,250 %, due 3/18/2020	947
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, due 3/31/2024	922
American Express Co, 3,700 %, due 11/5/2021	919
Vinci SA, 3,750 %, due 4/10/2029	841
Deutsche Telekom International Finance BV, 144A, 2,485 %, due 9/19/2023	775
Yamana Gold Inc, 4,950 %, due 7/15/2024	764
Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual	613
United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, due 11/15/2028	595
Republic of Panama, 3,160 %, due 1/23/2030	585
Citigroup Inc, 8,125 %, due 7/15/2039	571
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, due 1/15/2026	555

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	299.805
United States Treasury Floating Rate Note, 2,099 %, due 4/30/2021	256.928
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	145.015
United States Treasury Floating Rate Note, 2,070 %, due 1/31/2021	77.656
Norway Government Bond, Series 474, 144A, 3,750 %, due 5/25/2021	73.083
United States Treasury Floating Rate Note, 2,465 %, due 10/31/2020	62.442
United Kingdom Gilt, 2,000 %, due 7/22/2020	61.063
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	51.914
European Bank for Reconstruction & Development, 6,450 %, due 12/13/2022	39.724
United States Treasury Floating Rate Note, 2,485 %, due 4/30/2019	27.001
Colombian TES, Series B, 6,000 %, due 4/28/2028	17.709
Republic of Poland Government Bond, Series 1020, 5,250 %, due 10/25/2020	15.760
Queensland Treasury Corp, Series 21, 5,500 %, due 6/21/2021	10.744
United States Treasury Bill, zero coupon, due 4/25/2019	9.615
New South Wales Treasury Corp, 4,000 %, due 4/8/2021	6.130

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	302.194
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 8/15/2028	127.956
United States Treasury Floating Rate Note, 2,099 %, due 4/30/2021	126.089
United States Treasury Floating Rate Note, 2,465 %, due 10/31/2020	108.259
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, due 11/15/2048	92.762
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	79.021
United States Treasury Floating Rate Note, 2,070 %, due 1/31/2021	77.625
United Kingdom Gilt, 1,750 %, due 7/22/2019	64.695
European Investment Bank, 144A, 7,200 %, due 7/9/2019	43.586
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 11/15/2046	30.588
United States Treasury Floating Rate Note, 2,485 %, due 4/30/2019	27.001
Republic of Poland Government Bond, Series 0719, 3,250 %, due 7/25/2019	23.483
United States Treasury Floating Rate Note, 2,453 %, due 4/30/2020	20.037
Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, due 3/15/2023	19.284
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, due 2/28/2048	18.964
Kommunalbanken AS, 144A, 3,118 %, due 6/16/2020	17.762
United States Treasury Floating Rate Note, 2,420 %, due 1/31/2020	17.559
Queensland Treasury Corp, 144A, 4,000 %, due 6/21/2019	12.262
Norway Government Bond, Series 474, 144A, 3,750 %, due 5/25/2021	11.299
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	9.871

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	533.763
United States Treasury Floating Rate Note, 2,099 %, due 4/30/2021	160.295
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	49.670
United States Treasury Bill, 0 %, due 4/25/2019	21.047
United States Treasury Floating Rate Note, 2,075 %, due 1/31/2021	12.854
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, due 11/13/2042	6.169
Republic of Poland Government Bond, Series 0420, 1,500 %, due 4/25/2020	5.274
Colombian TES, Series B, 6,000 %, due 4/28/2028	4.179
Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, due 3/15/2023	3.975
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, due 3/15/2029	3.555
Australia Government Bond, Series 143, 2,750 %, due 10/21/2019	3.191
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, due 1/1/2021	3.079
Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 % due 5/31/2029	2.984
Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 % due 11/18/2038	2.984
United States Treasury Floating Rate Note, 2,005 %, due 10/31/2020	1.613
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, due 1/1/2027	1.490

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	540.750
United States Treasury Floating Rate Note, 2,453 %, due 4/30/2020	92.264
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, due 11/15/2048	52.637
United States Treasury Floating Rate Note, 2,005 %, due 10/31/2020	52.102
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, due 2/28/2048	42.074
Peru Government Bond, 144A, 6,150 %, due 8/12/2032	33.988
Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, due 2/28/2041	21.137
United States Treasury Bill, 0 %, due 4/25/2019	21.070
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, due 11/13/2042	15.163
Macquarie Bank Ltd, 144A, 3,144 %, due 4/4/2019	14.695
Republic of Poland Government Bond, Series 0719, 3,250 %, due 7/25/2019	13.760
Corp Andina de Fomento, 2,000 %, due 5/10/2019	11.380
Republic of Poland Government Bond, Series 0420, 1,500 %, due 4/25/2020	9.144
Colombian TES, Series B, 6,000 %, due 4/28/2028	8.651
Indonesia Treasury Bond, Series FR67, 8,750 %, due 2/15/2044	7.793
Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 % due 5/31/2029	7.326
Malaysia Government Bond, Series 0315, 3,659 %, due 10/15/2020	7.092
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10.000 %, due 1/1/2027	6.919
Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 % due 11/18/2038	6.814
Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, due 11/7/2047	5.944

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Clase	33.457
United States Treasury Floating Rate Note, 2,465 %, due 10/31/2020	8.703
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3,450 %, due 3/1/2048	5.334
PetSmart Inc, 144A, 5,875 %, due 6/1/2025	2.019
Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc, 4,625 %, due 5/15/2023	1.459
Koppers Inc, 6,000 %, due 12/15/2025	1.451
Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 5,875 %, due 6/1/2027	1.283
Petsmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022	1.212
Level 3 Financing Inc, 4,731 %, due 2/22/2024	996
Amkor Technology Inc, 6,625 %, due 5/15/2021	990
Scientific Games International Inc, 6,625 %, due 5/15/2021	986
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 5,125 %, due 5/1/2027	982
Tullow Oil Plc, 144A, 6,250 %, due 4/15/2022	980
CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp, 5,000 %, due 3/15/2024	975
Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 144A, 6,250 %, due 5/15/2026	974
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 6,000 %, due 2/15/2025	972
Teva Pharmaceutical Finance IV LLC, 2,250 %, due 3/18/2020	971
HCA Inc, 4,125 %, due 6/15/2029	970
Qorvo Inc, 5,500 %, due 7/15/2026	967
Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 7,125 %, due 6/15/2024	959
California Resources Corp, 144A, 8,000 %, due 12/15/2022	956
NRG Energy Inc, 6,625 %, due 1/15/2027	956
Ally Financial Inc, 4,625 %, due 5/19/2022	955
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, due 5/15/2022	952
SESI LLC, 7,125 %, due 12/15/2021	951
Univision Communications Inc, 144A, 5,125 %, due 5/15/2023	948
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, due 1/1/2021	945

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	35.554
United States Treasury Floating Rate Note, 2,465 %, due 10/31/2020	10.606
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3,450 %, due 3/1/2048	5.416
Level 3 Financing Inc, 4,731 %, due 2/22/2024	2.845
WR Grace & Co-Conn, 144A, 5,125 %, due 10/1/2021	2.826
CF Industries Inc, 4,950 %, due 6/1/2043	2.755
JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2007-CH3, Series 2007 CH3, Class A1B, 2,810 %, due 3/25/2037	2.574
Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,500 %, due 3/15/2022	2.307
WaMu Mortgage Pass-Through Series 2004-AR5 Trust, Series 2004 AR5, Class A6, 4,668 %, due 6/25/2034	2.069
Chesapeake Energy Corp, 6,037 %, due 4/15/2019	1.860
Rivers Pittsburgh Borrower LP/Rivers Pittsburgh Finance Corp, 144A, 6,125 %, due 8/15/2021	1.810
Argentine Republic Government International Bond, 5,875 %, due 1/11/2028	1.775
Sprint Corp, 7,250 %, due 9/15/2021	1.767
PetSmart Inc, 144A, 5,875 %, due 6/1/2025	1.746
Centene Corp, 5,625 %, due 2/15/2021	1.706
Sprint Capital Corp, 6,875 %, due 11/15/2028	1.683
Gray Television Inc, 144A, 5,125 %, due 10/15/2024	1.677
CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-I, Series 2004 I, Clase A, 2,485 %, due 2/15/2034	1.656
B&G Foods Inc, 4,625 %, due 6/1/2021	1.650
Allegheny Technologies Inc, 5,950 %, due 1/15/2021	1.625

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	269.413
United States Treasury Floating Rate Note, 2,099 %, due 4/30/2021	121.545
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	89.944
United States Treasury Floating Rate Note, 2,070 %, due 1/31/2021	58.138
United States Treasury Bill, zero coupon, due 4/25/2019	38.988
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	33.760
Colombian TES, Series B, 6,250 %, due 11/26/2025	13.702
Republic of Poland Government Bond, Series 1020, 5,250 %, due 10/25/2020	7.397
Queensland Treasury Corp, Series 21, 5,500 %, due 6/21/2021	7.067
Norway Government Bond, Series 474, 144A, 3,750 %, due 5/25/2021	5.862
New South Wales Treasury Corp, 4,000 %, due 4/8/2021	3.361

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	267.316
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 8/15/2028	79.815
United States Treasury Floating Rate Note, 2,070 %, due 1/31/2021	58.139
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, due 11/15/2048	57.756
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	48.221
United States Treasury Floating Rate Note, 2,099 %, due 4/30/2021	47.563
United Kingdom Gilt, 1,750 %, due 7/22/2019	39.952
United States Treasury Bill, zero coupon, due 4/25/2019	39.035
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 11/15/2046	18.288
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, due 2/28/2048	11.505
Republic of Poland Government Bond, Series 0719, 3,250 %, due 7/25/2019	9.375
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	7.878
Queensland Treasury Corp, 144A, 4,000 %, due 6/21/2019	7.103
United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, due 2/15/2029	6.195
Malaysia Government Bond, Series 0314, 4,048 %, due 9/30/2021	6.033
Republic of Poland Government Bond, Series 0420, 1,500 %, due 4/25/2020	4.131
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, due 11/13/2042	4.009
New South Wales Treasury Corp, 3,500 %, due 3/20/2019	3.361
Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, due 11/18/2038	3.352
Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, due 5/31/2029	3.200

Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	982.769
United States Treasury Floating Rate Note, 2,099 %, due 4/30/2021	352.782
United States Treasury Floating Rate Note, 2,075 %, due 1/31/2021	272.309
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	257.290
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	95.799
United Kingdom Gilt, 2,000 %, due 7/22/2020	58.417
Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, due 11/7/2047	56.976
United States Treasury Note/Bond, 0,000 %, due 4/25/2019	29.584
United States Treasury Floating Rate Note, 2,465 %, due 10/31/2020	23.533
Colombian TES, Series B, 6,250 %, due 11/26/2025	14.636
Malaysia Government Bond, Series 0315, 3,659 %, due 10/15/2020	7.996
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, due 3/15/2029	5.708
Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 % due 11/18/2038	5.495
United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, due 2/15/2029	4.423
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, due 11/13/2042	3.835
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, due 11/15/2048	3.648
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, due 1/1/2021	2.920
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 11/15/2046	2.371
Peru Government Bond, 144A, 6,150 %, due 8/12/2032	2.238
Australia Government Bond, Series 143, 2,750 %, due 10/21/2019	2.191

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	1.089.403
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	168.133
United States Treasury Floating Rate Note, 2,453 %, due 4/30/2020	165.412
United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, due 2/15/2029	116.096
United States Treasury Floating Rate Note, 2,075 %, due 1/31/2021	111.436
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, due 11/15/2048	110.480
United States Treasury Floating Rate Note, 2,420 %, due 1/31/2020	91.514
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	84.660
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 11/15/2046	75.089
Peru Government Bond, 144A, 6,150 %, due 8/12/2032	74.621
Republic of Poland Government Bond, Series 0420, 1,500 %, due 4/25/2020	71.070
United Kingdom Gilt, 1,750 %, due 7/22/2019	69.836
United States Treasury Floating Rate Note, 2,099 %, due 4/30/2021	55.244
Republic of Poland Government Bond, Series 0421, 2,000 %, due 4/25/2021	44.438
United States Treasury Floating Rate Note, 2,465 %, due 10/31/2020	37.283
United States Treasury Note/Bond, 0,000 %, due 4/25/2019	29.625
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, due 2/28/2048	23.445
Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, due 3/15/2023	17.797
Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, due 11/18/2038	17.701
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, due 3/15/2029	17.666

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	83.796
United States Treasury Floating Rate Note, 2,460 %, due 10/31/2020	34.593
United States Treasury Floating Rate Note, 2,070 %, due 1/31/2021	23.154
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	21.007
United States Treasury Floating Rate Note, 2,094 %, due 4/30/2021	11.598
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, due 5/15/2029	11.347
French Republic Government Bond OAT, 144A, 2,000 %, due 5/25/2048	9.828
United Kingdom Gilt, 1,500 %, due 7/22/2047	8.670
Buoni Poliennali Del Tesoro, 3,450 %, due 3/1/2048	8.647
Japan Treasury Note/Bond, 0,700 %, due 12/20/2048	6.001
United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, due 2/15/2029	5.947
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, due 10/22/2028	5.709
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	5.238
Belgium Treasury Note, 1,600 %, due 6/22/2047	4.369
Obrigacoes Do Tesouro, 4,100 %, due 2/15/2045	4.347
Japan Government Thirty Year Bond, Series 60, 0,900 %, due 9/20/2048	4.078
Irish Treasury Note, 1,500 %, due 5/15/2050	3.971
Spain Government Bond, 144A, 2,900 %, due 10/31/2046	3.844
Australia Government Bond, Series 150, 3,000 %, due 3/21/2047	2.632
IBM Corp, 2,850 %, due 5/13/2022	2.009

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	83.546
United States Treasury Floating Rate Note, 2,460 %, due 10/31/2020	34.590
United States Treasury Floating Rate Note, 2,070 %, due 1/31/2021	23.153
French Republic Government Bond OAT, 144A, 2,000 %, due 5/25/2048	16.776
Spain Government Bond, 144A, 2,900 %, due 10/31/2046	13.832
United States Treasury Floating Rate Note, 2,094 %, due 4/30/2021	11.593
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	9.651
Buoni Poliennali Del Tesoro, 3,450 %, due 3/1/2048	8.688
Japan Treasury Note/Bond, 0,700 %, due 12/20/2048	6.480
United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, due 2/15/2029	6.240
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,250 %, due 8/15/2048	5.958
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, due 10/22/2028	5.788
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, due 11/15/2048	5.585
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, due 2/15/2049	5.552
United Kingdom Gilt, 1,500 %, due 7/22/2047	5.334
Obrigacoes Do Tesouro, 4,100 %, due 2/15/2045	4.724
Belgium Treasury Note, 1,600 %, due 6/22/2047	4.551
Japan Government Thirty Year Bond, Series 60, 0,900 %, due 9/20/2048	4.166
Irish Treasury Note, 1,500 %, due 5/15/2050	4.119
American Express Co, 2,650 %, due 12/2/2022	2.923

Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	25.198
United States Treasury Floating Rate Note, 2,075 %, due 1/31/2021	6.060
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	4.135
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3,450 %, due 3/1/2048	3.649
COMM 2015-LC21 Mortgage Trust, Series 2015 LC21, Class AM, 4,043 %, due 7/10/2048	2.574
COMM 2015-CCRE26 Mortgage Trust, Series 2015 CR26, Class AM, 4,085 %, due 10/10/2048	2.373
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2019 R02, Class 1M2, 4,445 %, due 8/25/2031	2.032
COMM 2015-LC21 Mortgage Trust, Series 2015 LC21, Class D, 4,443 %, due 7/10/2048	2.022
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C32, Series 2015 C32, Class C, 4,816 %, due 11/15/2048	1.669
French Republic Government Bond OAT, 2,000 %, due 5/25/2048	1.406
Egypt Treasury Bill, Series 364D, zero coupon, due 6/11/2019	1.310
TDA 27 FTA 27, Class A3, 0,000 %, due 12/28/2050	1.271
Egypt Treasury Bill, Series 273D, zero coupon, due 6/18/2019	1.212
Portugal Obrigacoes do Tesouro, 4,100 %, due 2/15/2045	1.191
Towd Point Mortgage Trust 2017-5, Series 2017 5, Class A1, 144A, 2,745 %, due 2/25/2057	1.166
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 DNA3, Class B1, 6,045 %, due 9/25/2048	1.077
Egypt Treasury Bill, Series 273D, zero coupon, due 7/16/2019	1.070
Spain Government Bond, 2,900 %, due 10/31/2046	1.051
Level 3 Financing Inc, 4,484 %, due 2/22/2024	996
United Kingdom Gilt, 1,500 %, due 7/22/2047	936
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C27, Series 2015 C27, Class AS, 4,068 %, due 12/15/2047	883
COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust, Series 2014 CR15, Class B, 4,848 %, due 2/10/2047	881
FREMF 2014-K716 Mortgage Trust, Series 2014 K716, Class B, 144A, 4,079 %, due 8/25/2047	830
FREMF 2017-K61 Mortgage Trust, Series 2017 K61, Class C, 144A, 3,809 %, due 12/25/2049	789

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	27.489
United States Treasury Floating Rate Note, 2,075 %, due 1/31/2021	5.490
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3,450 %, due 3/1/2048	3.681
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, due 5/15/2049	2.235
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2019 R02, Class 1M2, 4,445 %, due 8/25/2031	2.025
JP Morgan Mortgage Acquisition Corp 2005-OPT2, Series 2005 OPT2, Class M3, 2,970 %, due 12/25/2035	1.772
Egypt Treasury Bill, Series 364D, zero coupon, due 6/11/2019	1.417
French Republic Government Bond OAT, 2,000 %, due 5/25/2048	1.379
Egypt Treasury Bill, Series 273D, zero coupon, due 6/18/2019	1.298
Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Ctfs Ser 2005-R8, Series 2005 R8, Class M3, 3,255 %, due 10/25/2035	1.265
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C03, Class 2M2, 8,045 %, due 10/25/2028	1.264
Portugal Obrigacoes do Tesouro, 4,100 %, due 2/15/2045	1.201
FBR Securitization Trust 2005-2, Series 2005 2, Class M2, 2,895 %, due 9/25/2035	1.161
Egypt Treasury Bill, Series 273D, zero coupon, due 7/16/2019	1.126
Park Place Securities Inc Asset Backed Pass Through Certificates Ser 2005-WHQ3, Series 2005 WHQ3, Class M3, 2,850 %, due 6/25/2035	1.072
Spain Government Bond, 2,900 %, due 10/31/2046	1.059
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 DNA3, Class B1, 6,045 %, due 9/25/2048	1.055
Level 3 Financing Inc, 4,484 %, due 2/22/2024	1.001
Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Ctfs Ser 2004-R8, Series 2004 R8, Class M2, 3,510 %, due 9/25/2034	965
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C01, Class 1M2, 8,895 %, due 8/25/2028	958
United Kingdom Gilt, 1,500 %, due 7/22/2047	924
Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2006 5, Class 1A, 2,345 %, due 8/25/2036	906
FREMF 2014-K716 Mortgage Trust, Series 2014 K716, Class B, 144A, 4,079 %, due 8/25/2047	829
SoFi Professional Loan Program 2015-d LLC, Series 2015 D, Class A2, 144A, 2,720 %, due 10/27/2036	745

Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4.060
United States Treasury Floating Rate Note, 2,000 %, due 10/31/2020	809
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3,450 %, due 3/1/2048	567
PetSmart Inc, 144A, 5,875 %, due 6/1/2025	381
Turkey Government International Bond, 4,875 %, due 4/16/2043	312
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3,000 %, due 8/1/2029	306
First Quantum Minerals Ltd, 7,250 %, due 5/15/2022	205
Perrigo Finance Unlimited Co, 3,900 %, due 12/15/2024	204
Tullow Oil Plc, 144A, 6,250 %, due 4/15/2022	202
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,625 %, due 5/15/2023	201
BRF SA, 3,950 %, due 5/22/2023	199
Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 5,250 %, due 12/1/2021	158
Koppers Inc, 144A, 6,000 %, due 2/15/2025	154
Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 5,875 %, due 6/1/2027	135
Petsmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022	133
Energy Transfer Operating LP, 5,500 %, due 6/1/2027	126
Qorvo Inc, 5,500 %, due 7/15/2026	111

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4.363
United States Treasury Floating Rate Note, 2,000 %, due 10/31/2020	809
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3,450 %, due 3/1/2048	562
WaMu Mortgage Pass-Through Series 2004-AR5 Trust, Series 2004 AR5, Class A6, 4,668 %, due 6/25/2034	482
Park Place Securities Inc Asset Backed Pass Through Certificates Ser 2005-WHQ3, Series 2005 WHQ3, Class M3, 2,850 %, due 6/25/2035	372
Towd Point Mortgage Trust 2018-5, Series 2018 5, Class A1A, 144A, 3,250 %, due 7/25/2058	369
Thornburg Mortgage Securities Trust 2004-2, Series 2004 2, Class A1, 2,765 %, due 6/25/2044	359
CF Industries Inc, 4,950 %, due 6/1/2043	325
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3,000 %, due 8/1/2029	312
Centene Corp, 5,625 %, due 2/15/2021	305
Rowan Cos Inc, 4,750 %, due 1/15/2024	289
HCA Inc, 4,750 %, due 5/1/2023	284
Sequoia Mortgage Trust 2004-8, Series 2004 8, Class A2, 2,757 %, due 9/20/2034	189

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

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

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Transocean Guardian Ltd, 144A, 5,875 %, due 1/15/2024	111
SESI LLC, 7,125 %, due 12/15/2021	110
Amkor Technology Inc, 6,625 %, due 9/15/2027	109
California Resources CRP, 8,000 %, due 12/15/2022	107
Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 144A, 6,250 %, due 5/15/2026	106
CIT Group Inc, 5,000 %, due 8/1/2023	105
Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 9,375 %, due 4/1/2027	105
HCA Inc, 4,125 %, due 6/15/2029	104

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
B&G Foods Inc, 4,625 %, due 6/1/2021	171
Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-RFC1, Series 2006 RFC1, Class A4, 2.385 %, due 3/25/2036	169
Rivers Pittsburgh Borrower LP/Rivers Pittsburgh Finance Corp, 144A, 6,125 %, due 8/15/2021	168
Petsmart Inc, 6,210 %, due 3/11/2022	145
RASC Series 2006-KS7 Trust, Series 2006 KS7, Class A4, 2,385 %, due 9/25/2036	138
Energy Transfer LP, 5,500 %, due 6/1/2027	126
GEO Group Inc/The, 6,000 %, due 4/15/2026	120
First Data Corporation, 5,000 %, due 1/15/2024	113

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	114.659
United States Treasury Floating Rate Note, 2,099 %, due 4/30/2021	93.919
United States Treasury Floating Rate Note, 2,875 %, due 5/15/2049	56.049
United States Treasury Floating Rate Note, 2,535 %, due 1/31/2021	23.227
Argentina Treasury Bond BONCER, 2,500 %, due 7/22/2021	13.363
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, due 11/13/2042	8.033
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, due 2/28/2048	7.114
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, due 1/1/2027	6.830
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, due 3/15/2029	6.509
Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, due 11/7/2047	4.765
Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, due 3/10/2022	3.813
Argentine Republic Government International Bond, 5,875 %, due 1/11/2028	3.136
Colombian TES, Series B, 6,000 %, due 4/28/2028	3.011
Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 % due 11/18/2038	2.364
Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 % due 5/31/2029	1.935
Peru Government Bond, 144A, 6,150 %, due 8/12/2032	1.870
Australia Government Bond, Series 143, 2,750 %, due 10/21/2019	1.479
Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, due 2/28/2041	1.173

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	115.140
United States Treasury Floating Rate Note, 2,875 %, due 5/15/2049	59.114
United States Treasury Floating Rate Note, 2,465 %, due 10/31/2020	50.878
United States Treasury Floating Rate Note, 2,535 %, due 1/31/2021	23.214
United States Treasury Floating Rate Note, 2,099 %, due 4/30/2021	22.579
Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, due 11/7/2047	13.920
Peru Government Bond, 144A, 6,150 %, due 8/12/2032	11.233
Republic of Poland Government Bond, Series 0420, 1,500 %, due 4/25/2020	7.590
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, due 2/28/2048	2.697
Republic of Poland Government Bond, Series 0421, 2,000 %, due 4/25/2021	2.634
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, due 11/13/2042	2.598
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10.000 %, due 1/1/2027	1.344
Indonesia Treasury Bond, Series FR72, 8,250 %, due 5/15/2036	1.161
Colombian TES, Series B, 6,000 %, due 4/28/2028	581

Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	433
Honeywell International Inc	129
Booking Holdings Inc	117
Wells Fargo & Co	116
Gilead Sciences Inc	113
Boeing Co/The	98
Union Pacific Corp	98
3M Co	93
Caterpillar Inc	86
Altria Group Inc	84
Biogen Inc	74
General Motors Co	67
Walgreens Boots Alliance Inc	58
International Business Machines Corp	54
Synchrony Financial	50
Citigroup Inc	49
CSX Corp	49
Bristol-Myers Squibb Co	45
Texas Instruments Inc	43
Cummins Inc	42
Norfolk Southern Corp	42
eBay Inc	38
Southwest Airlines Co	37
American Express Co	32
Illinois Tool Works Inc	31
Nucor Corp	31
Procter & Gamble Co/The	32

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	427
Union Pacific Corp	195
Home Depot Inc/The	171
Cisco Systems Inc	161
Starbucks Corp	143
CitiGroup Inc	137
Morgan Stanley	127
Gilead Sciences Inc	111
Honeywell International Inc	104
Metlife Inc	101
Oracle Corp	95
Phillips 66	95
Boeing Co/The	91
Amgen Inc	87
Intel Corp	87
Apple Inc	86
Ameriprise Financial Inc	72
Bristol-Myers Squibb Co	69
CSX Corp	69
Pfizers Inc	63
General Motors Co	62
SunTrust Banks Inc	60
Prudential Financial Inc	58
Occidental Petroleum Corp	57
Marathon Petroleum Corp	53
Humana Inc	48
Kroger Co/The	47
Las Vegas Sands Corp	47
Regions Financial Corp	46
Bank of America Corp	45
Valero Energy Corp	44

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason ClearBridge Value Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Altria Group Inc	5.357
Advance Auto Parts Inc	4.508
CVS Health Corp	4.233
DXC Technology Co	3.912
Bristol-Myers Squibb Co	3.517
AXA Equitable Holdings Inc	2.442
Allergan Plc	1.735
QUALCOMM Inc	1.714
Capri Holdings Ltd	1.503
Citigroup Inc	1.198
Anheuser-Busch InBev SA/NV ADR	1.030
Corteva Inc	1.028
International Business Machines Corp	838
Conagra Brands Inc	704
NetApp Inc	545
Encana Corp	513
Royal Gold Inc	502
Mylan NV	403
Synchrony Financial	391
Delta Air Lines Inc	356

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
AutoZone Inc	8.370
Merck & Co Inc	8.086
Universal Health Services Inc	6.890
Alexion Pharmaceuticals Inc	4.153
Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	3.282
Fluor Corp	3.272
Oracle Corp	2.916
MetLife Inc	2.862
Realogy Holdings Corp	2.829
AECOM	2.805
Alphabet Inc	2.290
Brighthouse Financial Inc	2.029
ABB Ltd ADR	1.954
Biogen Inc	1.878
AES Corp/VA	1.268
Owens Corning	1.083
Exelon Corp	900
Voya Financial Inc	788
Pioneer Natural Resources Co	539
Synchrony Financial	199

Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Baidu Inc ADR	1045
Julius Baer Group Ltd	540
Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	526
Anheuser-Busch InBev SA/NV ADR	503
Atos SE	410
Encana Corp	269
Glencore Plc	166
Cybg Plc	129
Capri Holdings Ltd	112
Imperial Brands Plc	82
TOTAL SA	7

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Baidu Inc ADR	714
Reckitt Benckiser Group Plc	519
Ryanair Holdings Plc ADR	514
Danone SA	393
BP Plc	392
Dick's Sporting Goods Inc	376
UBS Group AG	366
Bayer AG	362
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	355
Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	321
Wells Fargo & Co	319
Rio Tinto Ltd	317
Mylan NV	312
Infosys Ltd ADR	309
American International Group Inc	301
Royal Dutch Shell Plc 'A'	288
Merck & Co Inc	277
Roche Holding AG	276
Allergan Plc	272
Anheuser-Busch InBev SA/NV ADR	266
BNP Paribas SA	265
Bayerische Motoren Werke AG	264
Thai Union Group PCL	257
TOTAL SA	251
Glencore Plc	247
AT&T Inc	238
Standard Life Aberdeen Plc	237
Standard Chartered Plc	235
Nutrien Ltd Npv	224
Safran SA	224
Volkswagen AG	223
Imperial Brands Plc	222
DR Horton Inc	220
Hitachi Ltd	219
Akzo Nobel NV	216
CNH Industrial NV	214
Julius Baer Group Ltd	214
Diageo Plc	212
Cisco Systems Inc	211
Continental AG	208
Honda Motor Co Ltd,	205
Duratex SA	189

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Facebook Inc 'A'	2.904
American International Group Inc	1.416
United Parcel Service Inc 'B'	1.136
salesforce.com Inc	895
Sherwin-Williams Co/The	814
Air Products & Chemicals Inc	617
Apple Inc	500
Wells Fargo & Co	436
Bank of America Corp	334
Kinder Morgan Inc/DE	294
ASML Holding NV	253
DowDuPont Inc	193
Corteva Inc	156
Chevron Corp	127
United Technologies Corp	61

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
UnitedHealth Group Inc	2.192
Anadarko Petroleum Corp	1.890
Alphabet Inc 'A'	1.588
Alphabet Inc	1.528
Home Depot Inc/The	1.260
Microsoft Corp	1.005
JPMorgan Chase & Co	799
Apple Inc	774
SAP SE ADR	634
Berkshire Hathaway Inc	601
MetLife Inc	599
Comcast Corp	580
Merck & Co Inc	486
Johnson & Johnson	449
Adobe Inc	418
Dow Inc	410
WW Grainger Inc	407
Visa Inc 'A'	400
Walt Disney Co/The	400
American International Group Inc	364
Becton Dickinson and Co	334
Honeywell International Inc	322
Verizon Communications Inc	301
Automatic Data Processing Inc	300
Raytheon Co	295
Bank of New York Mellon Corp/The	288
PPG Industries Inc	274
American Tower Corp	271
US Bancorp	270
Cisco Systems Inc	269
Walmart Inc	263
3M Co	261
Travelers Cos Inc/The	260

Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Advance Auto Parts Inc	24.451
Uber Technologies Inc	21.006
Fidelity National Information Services Inc	14.856
Booking Holdings Inc	12.802
Ch Robinson Worldwide Inc	11.152
United Parcel Service Inc	9.038
Alibaba Group Holding Ltd ADR	8.198
UnitedHealth Group Inc	8.188
Johnson & Johnson	8.000
Pioneer Natural Resources Co	7.738
GrubHub Inc	7.487
Facebook Inc	5.842
Comcast Corp	4.856
Amazon.com Inc	4.550
Charles Schwab Corp/The 19.801	4.002
Ariad Pharmaceuticals Inc	3.816
Nutanix Inc	3.680
Qualcomm Inc	3.492
Visa Inc 'A'	3.438
Thermo Fisher Scientific Inc	3.157
NVIDIA Corp	3.134
BioMarin Pharmaceutical Inc	2.771
IHS Markit Ltd	2.246

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
PayPal Holdings Inc	36.305
Yum China Holdings Inc	24.130
Red Hat Inc	23.586
Coca-Cola Co/The	21.623
Biogen Inc	21.336
Amazon.com Inc	14.617
Schlumberger Ltd	13.550
Facebook Inc 'A'	12.387
Microsoft Corp	11.942
Regeneron Pharmaceuticals Inc	10.613
Comcast Corp	10.400
Visa Inc 'A'	10.384
Equinix Inc	9.189
Apple Inc	9.148
Honeywell International Inc	8.564
Alphabet Inc	8.317
Ecolab Inc	7.396
Adobe Inc	7.262
Costco Wholesale Corp	7.060
UnitedHealth Group Inc	7.049
Akamai Technologies Inc	6.917
Walt Disney Co/The	6.469
BlackRock Inc	6.380
Caterpillar Inc	6.191
Zoetis Inc	6.151
Thermo Fisher Scientific Inc	5.632
Splunk Inc	5.566
QUALCOMM Inc	5.505
Oracle Corp	5.421
Anheuser-Busch InBev SA/NV ADR	5.081
Home Depot Inc/The	4.825
WW Grainger Inc	4.714
Charles Schwab Corp/The	4.428
American Express Co	4.343
Palo Alto Networks Inc	4.312
Texas Instruments Inc	4.279

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
FireEye Inc	3.890
Cree Inc	2.217
Voyager Therapeutics Inc	1.379

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Anadarko Petroleum Corp	64.390
UnitedHealth Group Inc	41.296
Ionis Pharmaceuticals Inc	26.994
Johnson Controls International plc	21.566
Comcast Corp	21.523
Allergan Plc	19.344
Nuance Communications Inc,	16.525
Seagate Technology Plc	14.064
TE Connectivity Ltd	11.897
Madison Square Garden Co/The	11.818
Broadcom Inc	11.724
Twitter Inc	11.677
Fluor Corp	10.526
Cree Inc	9.682
Discovery Inc	9.174
Amgen Inc	8.648
Core Laboratories NV	8.031
Liberty Broadband Corp	7.803
Liberty Broadband Corp	7.282
Medtronic Plc	7.125
Autodesk Inc	6.781
Nucor Corp	4.555

Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Rattler Midstream LP, MLP	570
Western Digital Corp	534
Owl Rock Capital Corp	459
Edison International	351
Two Harbors Investment Corp	344
Altria Group Inc	257
Blackstone Group Inc/The	235
Transdigm Group Inc	225
United Technologies Corp	190
QUALCOMM Inc	164
Corteva Inc	109
Intel Corp	84
Apartment Investment & Management Co	22

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Microsoft Corp	822
Citigroup Inc	699
Annaly Capital Management Inc	549
Tallgrass Energy LP	487
Brookfield Infrastructure Partners LP, MLP	480
CenterPoint Energy Inc	445
Oracle Corp	406
Keurig Dr Pepper Inc	377
International Paper Co	374
AstraZeneca Plc	366
BlackRock TCP Capital Corp	360
Bank of America Corp	353
Exelon Corp	344
MetLife Inc	303
NextEra Energy Inc	303
Enbridge Inc	295
QUALCOMM Inc	276
Texas Instruments Inc	252
Verizon Communications Inc	251
Paychex Inc	236
International Business Machines Corp	229
GlaxoSmithKline Plc	225
Stanley Black & Decker Inc	223
Transdigm Group Inc	211
Kimberly-Clark Corp	209
Pfizer Inc	207
Hoegh LNG Partners LP	176
Merck & Co Inc	173
Procter & Gamble Co/The	173
ONEOK Inc	162
Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP	154
Raytheon Co	145
United Technologies Corp	145
General Motors Co	139
Williams Cos Inc/The	139

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Merck & Co Inc	257
Apple Inc	216
Microsoft Corp	206
Keysight Technologies Inc	199
Bank of America Corp	164
Lyft Inc	154
Lam Research Corp	132
Alphabet Inc 'A'	123
BioMarin Pharmaceutical Inc	115
Costco Wholesale Corp	114
Ecolab Inc	111
Walt Disney Co/The	104
Visa Inc, A	103
Home Depot Inc/The	99
Unilever NV	98
Progressive Corp/The	94
Danaher Corp	93
Trex Co Inc	93
Evoqua Water Technologies Corp	88
NIKE Inc	87
Automatic Data Processing Inc	85
Starbucks Corp	84
US Bancorp	83
Ingersoll-Rand Plc	82
Hartford Financial Services Group Inc/The	81
BlackRock Inc	79
Equinix Inc	79
Becton Dickinson and Co	74
Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP	71
Autodesk Inc	67
First Republic Bank/CA	67
Vestas Wind Systems A/S ADR	64
Colgate-Palmolive Co	60
Xylem Inc/NY	59
Ormat Technologies Inc	57
NextEra Energy Inc	56
Jones Lang LaSalle Inc	55
Charles Schwab Corp/The	53
SolarEdge Technologies Inc	53
Rockwell Automation Inc	47
UnitedHealth Group Inc	47
Alexion Pharmaceuticals Inc	45

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WABCO Holdings Inc	169
Biogen Inc	138
UnitedHealth Group Inc	135
Cott Corp	85
Ecolab Inc	73
Autodesk Inc	65
NIKE Inc	51
Danaher Corp	42
Walt Disney Co/The	39
Automatic Data Processing Inc	34
Microsoft Corp	30
Becton Dickinson and Co	27
Apple Inc	19
Alphabet Inc 'A'	18
Costco Wholesale Corp	15
Progressive Corp/The	14
Visa Inc, A	14
Unilever NV	14
BlackRock Inc	13
Trex Co Inc	13

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	135.729
Emergent BioSolutions Inc	3.938
Bloom Energy Corp	3.904
Generac Holdings Inc	3.500
Tabula Rasa HealthCare Inc	3.250
Advanced Energy Industries Inc	2.619
BioTelemetry Inc	2.373
Ameresco Inc	2.360
Realogy Holdings Corp	2.268
US Concrete Inc	2.165
Addus HomeCare Corp	2.130
Century Communities Inc	2.086
Eventbrite Inc	1.973
Primoris Services Corp	1.889
American Eagle Outfitters Inc	1.845
Armada Hoffler Properties Inc	1.798
Fabrinet	1.751
Cambrex Corp	1.569
IntriCon Corp	1.555
Applied Optoelectronics Inc	1.495

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	149.394
Cray Inc	9.399
Meritor Inc	6.817
Kratos Defense & Security Solutions Inc	6.667
Avon Products Inc	6.661
Cypress Semiconductor Corp	6.447
Wesco Aircraft Holdings Inc	6.120
Carpenter Technology Corp	6.045
KeyW Holding Corp/The	5.927
Cambrex Corp	5.825
Amber Road Inc	5.582
Granite Construction Inc	5.399
Synaptics Inc	5.383
PCM Inc	5.120
Mueller Industries Inc	5.073
Milacron Holdings Corp	5.036
Apogee Enterprises Inc	4.628
Allegheny Technologies Inc	4.568
Univar Inc	4.380
Mueller Water Products Inc 'A'	4.308

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	13.787
iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.714
Arcosa Inc	1.698
Insight Enterprises Inc	1.427
SPDR S&P 600 Small CapValue ETF – ETF	1.233
G-III Apparel Group Ltd	1.142
Patrick Industries Inc	1.021
Kennametal Inc	996
Heidrick & Struggles International Inc	823
Caleres Inc	805
Johnson Outdoors Inc	682
TGS NOPEC Geophysical Co ASA	646
Meritor Inc	639
Pfenex Inc	621
Pason Systems Inc	592
FBL Financial Group Inc	570
Children's Place Inc/The	543
Movado Group Inc	514
Sterling Construction Co Inc	511
Fabrinet	456
Colfax Corp	441
Wolverine World Wide Inc	430
Vishay Precision Group Inc	424

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (Distribución)	17.913
Arcosa Inc	2.080
Advanced Energy Industries Inc	1.813
Greenbrier Cos Inc/The	1.396
Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	1.142
UniFirst Corp/MA	1.102
John Bean Technologies Corp	1.031
CIRCOR International Inc	1.009
Genworth MI Canada Inc	968
Wabash National Corp	956
Apogee Enterprises Inc	891
LCI Industries	880
Minerals Technologies Inc	822
MKS Instruments Inc	752
SPDR S&P 600 Small CapValue ETF – ETF	750
EW Scripps Co/The 'A'	716
j2 Global Inc	701
Marcus & Millichap Inc	699
Inter Parfums Inc	685
RLI Corp	685
Kennedy-Wilson Holdings Inc	663
Sun Hydraulics Corp	660
Meritor Inc	636
Houlihan Lokey Inc 'A'	632

Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Evraz Plc	495
Recordati SpA	492
Aroundtown SA	487
Sodexo SA	487
TAG Immobilien AG	484
Bunzl Plc	483
Pandora A/S	257
Telefonica Deutschland Holding AG	239
British American Tobacco Plc	107

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Tesco Plc	649
Wm Morrison Supermarkets Plc	620
BAE Systems Plc	612
Burberry Group Plc	561
Electrolux AB	557
National Grid Plc	515
Telia Co AB	509
Freenet AG	463
Sydbank A/S	449
Vodafone Group Plc	445
William Hill Plc	431
Bayer AG	388
Snam SpA	294
Deutsche Lufthansa AG	270
Tate & Lyle Plc	270
SBM Offshore NV	203
Diageo Plc	193
Persimmon Plc	130
LEG Immobilien AG	124
Telenet Group Holding NV	124
Safran SA	117
Alcon Inc	109
SES SA 'A'	107
Neste Oyj	101
Royal Dutch Shell Plc 'A'	99
ICA Gruppen AB	98
Telenor ASA	98
Endesa SA	97
Hannover Rueck SE	96
Rio Tinto Plc	96

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

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
iShares MSCI All Country Asia ex-Japan ETF	13.182
CITIC Ltd	1.042
Coca-Cola Amatil Ltd	918
Dali Foods Group Co Ltd, 144A	867
Bermaz Auto Bhd	849
Coal India Ltd	848
CGN Power Co Ltd, 144A	836
CapitaLand Retail China Trust	827
First Real Estate Investment Trust	753
Pruksa Holding PCL, NVDR	727
Aurizon Holdings Ltd	562
McMillan Shakespeare Ltd	484
Bioteque Corp	438
Firstsource Solutions Ltd	435
Ascott Residence Trust	362
Major Cineplex Group PCL	285
NHPC Ltd	273

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
iShares MSCI All Country Asia ex-Japan ETF	13.015
Techtronic Industries Co Ltd	1.211
Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1.173
Spark New Zealand Ltd	976
Vanguard International Semiconductor Corp	916
Genesis Energy Ltd	875
Glow Energy PCL, NVDR	810
PCCW Ltd	737
Northern Star Resources Ltd	703
Aristocrat Leisure Ltd	691
Dongwon Industries Co Ltd	668
Sun Art Retail Group Ltd	643
Singapore Technologies Engineering Ltd	614
China Communications Construction Co Ltd	570
Amcor Ltd/Australia	567
Genting Singapore Ltd	495
Siam Commercial Bank PCL/The, NVDR	478
Korea Electric Power Corp	377
Thai Oil PCL, NVDR	375
Bursa Malaysia Bhd	236

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
iShares MSCI ACWI ETF – ETF	240
Mitsubishi Chemical Holdings Corp	130
CNOOC Ltd ADR	120
Gilead Sciences Inc	66
Imperial Brands Plc	24

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Infratil Ltd	185
CTCI Corp	160
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	151
Bank Hapoalim BM	114
British American Tobacco Malaysia Bhd	57
National Grid Plc	37
Blackstone Mortgage Trust Inc 'A'	36
AmeriGas Partners LP, MLP	22
Starwood Property Trust Inc	15
Assicurazioni Generali SpA	13
Mapletree Logistics Trust	2

Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	7.201
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2.729
HDFC Bank Ltd	1.801
Minth Group Ltd	1.039
ENN Energy Holdings Ltd	800
TravelSky Technology Ltd	646
HSBC Holdings Plc	508
Jardine Matheson Holdings Ltd	202

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Maruti Suzuki India Ltd	4.565
HDFC Bank Ltd ADR	3.509
Genting Bhd	3.427
Cafe de Coral Holdings Ltd	2.707
AIA Group Ltd	2.593
Matahari Department Store Tbk PT	1.858
Siam Commercial Bank PCL/The	1.808
Guangdong Investment Ltd	1.114
Infosys Ltd ADR	1.103
Coway Co Ltd	973
Tencent Holdings Ltd	578
Television Broadcasts Ltd	453
China Mobile Ltd	439
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	355
Singapore Technologies Engineering Ltd	322
United Overseas Bank Ltd	285
Jardine Matheson Holdings Ltd	244
Hero MotoCorp Ltd	242
Tata Consultancy Services Ltd	238
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	196

Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Alibaba Group Holding Ltd ADR	324
Longi Green Energy Technology Co Ltd	318
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	310
Foshan Haitian Flavouring Co Ltd	295
Wuliangye Yibin Co Ltd	287
Baidu Inc ADR	245
MediaTek Inc	216
Minth Group Ltd	204
Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd	193
Tencent Holdings Ltd	192
Macronix International	172
Largan Precision Co Ltd	145
Shennan Circuits Co Ltd	132
YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co Ltd, 144A	119
Agile Group Holdings Ltd	77
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	67
Pinduoduo Inc ADR	67
Vipshop Holdings Ltd ADR	59
NetEase Inc ADR	54
New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	37

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd	352
Foshan Haitian Flavouring Co Ltd	345
China Mobile Ltd	343
Baidu Inc ADR	225
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	218
Zai Lab Ltd ADR	217
Vitasoy International Holdings Ltd	190
Longi Green Energy Technology Co Ltd	144
Wuliangye Yibin Co Ltd	142
Chunghwa Precision Test Tech Co Ltd	137
Xinyi Glass Holdings Ltd	135
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	134
Shennan Circuits Co Ltd	132
Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Ltd Co, 144A	129
Hota Industrial Manufacturing Co Ltd	124
Tencent Holdings Ltd	120
Largan Precision Co Ltd	120
iQIYI Inc ADR	105
Industrial & Commercial Bank of China Ltd	103
China Merchants Bank Co Ltd	94
China Construction Bank Corp	90
CK Asset Holdings Ltd	88
Guangdong Investment Ltd	76
China Molybdenum Co Ltd	74
Pinduoduo Inc ADR	64
China Life Insurance Co Ltd	58
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	50
E.Sun Financial Holding Co Ltd	49

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Masimo Corporation	979
Microsoft Corp	943
Hexagon AB	849
Resmed Inc	742
Unilever NV	356
Canadian Natl Railway Co	206
AIA Group Ltd	97
Straumann Holding AG	97
Automatic Data Processing	95
Starbucks Corp	92
Mastercard Inc	86
Tencent Holdings Ltd	81
Waters Corp	81
Linde Plc	76
Coloplast-B	74
Taiwan Semiconductor Manufac	73
Atlas Copco AB	72
Assa Abloy AB	71
Spirax-Sarco Engineering Plc	70
Accenture Plc	69
Nike Inc	66
Check Point Software Technologies LTD	64
Kerry Group Plc	64

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Mettler-Toledo International	886
Reckitt Benckiser Group Plc	859
Rockwell Automation Inc	725
Cie Financiere Richemont SA	716
Apple Inc	662
Cognizant Tech Solutions Corp	655
Croda International Plc	442
Prudential Plc	439

Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Kotak Mahindra Bank Ltd	404
ICICI Bank Ltd	401
IRB Brasil Resseguros S/A	326
Odontoprev SA	278
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	97
Samsung Electronics Co Ltd	96
Alibaba Group Holding Ltd ADR	93
Tencent Holdings Ltd	90
Naspers Ltd	47
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	47
OTP Bank Nyrt	40
Industrial & Commercial Bank of China Ltd	38
AIA Group Ltd	36
Credicorp Ltd	36
Titan Co Ltd	34
LG Chem Ltd	32
LUKOIL PJSC ADR	32
Cosan Ltd	30
EPAM Systems Inc	30
China Gas Holdings Ltd	28
CNOOC Ltd	28
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	28
SK Hynix Inc	27

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
CTBC Financial Holding Co Ltd	366
EPAM Systems Inc	142
Samsung Electronics Co Ltd	97
Tencent Holdings Ltd	78
Alibaba Group Holding Ltd ADR	77
Aspen Pharmacare Holdings Ltd	72
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	71
Multichoice Group Ltd	32

Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR
adidas AG	189
Kering SA	187
Ferrari NV	185
Straumann Holding AG	184
Infineon Technologies AG	170
Hexagon AB	167
Unilever NV	161
ASML Holding NV	134
Mettler-Toledo International Inc	131
Beazley Plc	130
Moncler SpA	129
Atlas Copco AB	123
Temenos AG	120
L'Oreal SA	117
Coloplast A/S	116
Assa Abloy AB	109
Spirax-Sarco Engineering Plc	109
Check Point Software Technologies Ltd	108
Cie Financiere Richemont SA	105
Amadeus IT Group SA	95
Croda International Plc	87
Partners Group Holding AG	81
Unilever NV	60

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Cie Financiere Richemont SA	238
Croda International Plc	164
Spirax-Sarco Engineering Plc	52
Temenos AG	1

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (*Fortsetzung*)

Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR
Red Electrica Corp SA	23.007
Hydro One Ltd, 144A	19.836
Cheniere Energy Inc	19.449
Fortis Inc/Canada	11.922
Aqua America Inc	9.630
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	9.525
Norfolk Southern Corp	9.333
SSE Plc	9.122
Severn Trent Plc	8.908
Vinci SA	7.699
Dominion Energy Inc	7.635
Spark Infrastructure Group	5.675
FirstEnergy Corp	5.494
NextEra Energy Partners LP	5.181
Equatorial Energia SA	4.711
Public Service Enterprise Group Inc	4.672
Clearway Energy Inc 'C'	4.523
National Grid Plc	4.296
Enbridge Inc	4.280
Transurban Group	4.184
United Utilities Group Plc	4.071
Sempra Energy	3.883
Union Pacific Corp	3.883
Williams Cos Inc/The	3.862
Emera Inc	3.655
Atlantia SpA	2.885
American Electric Power Co Inc	2.810

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Genesee & Wyoming Inc 'A'	14.439
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	10.803
Atlantia SpA	10.292
Kinder Morgan Inc/DE	9.736
APA Group	9.489
Williams Cos Inc/The	9.415
PG&E Corp	8.939
Crown Castle International Corp	8.781
American Electric Power Co Inc	8.746
Edison International	8.339
Vinci SA	8.072
Transurban Group	7.777
Emera Inc	7.568
National Grid Plc	7.157
Spark Infrastructure Group	5.726
NextEra Energy Inc	4.891
CFE Capital S de RL de CV	3.580
Enbridge Inc	3.284
Pennon Group Plc	3.125
ALEATICA SAB de CV	2.322
Aqua America Inc	2.115
Aeroports de Paris	2.104

Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Aguas Andinas SA	83
Neoenergia SA	50
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	37
Equatorial Energia SA	36
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	29
Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA	28
Petronet LNG Ltd	28
IRB Infrastructure Developers Ltd	24
China Merchants Port Holdings Co Ltd	6

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	51
Cia Energetica de Sao Paulo	42
Gujarat State Petronet Ltd	36
Telesites SAB de CV	36
Energisa SA	35
Equatorial Energia SA	35
Canvest Environmental Protection Group Co Ltd	29
Beijing Enterprises Water Group Ltd	15
CFE Capital S de RL de CV	4
Bharti Infratel Ltd	2
GMexico Transportes SAB de CV, 144A	2
Indraprastha Gas Ltd	2
Jasa Marga Persero Tbk PT	2
Mahanagar Gas Ltd	2
Malaysia Airports Holdings Bhd	2
China Gas Holdings Ltd	1
Container Corp Of India Ltd	1
Enel Americas SA (Rights)	1
Enel Americas SA	1
Power Grid Corp of India Ltd	1

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Anhang: EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften („SFT-Verordnung“)

In den folgenden Tabellen sind der Gesamt-Bruttonennwert für umgekehrte Pensionsgeschäfte, Total Return Swaps und Differenzkontrakte sowie der absolute beizulegende Zeitwert als Anteil des Nettoinventarwerts jedes Fonds, analysiert nach Gegenparteien, zum 31. August 2019 angegeben:

Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Gegenpartei	Gründungsland	Gesamt-Bruttonennwert (in Tsd.) USD	Absoluter beizulegender Zeitwert (in Tsd.) USD	% des Netto-insgesamt
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund				
Bank of America Merrill Lynch	USA	89.400	89.400	6,62
		89.400	89.400	6,62

Total Return Swaps

Gegenpartei	Gründungsland	Gesamt-Bruttonennwert (in Tsd.) USD	Absoluter beizulegender Zeitwert (in Tsd.) USD	% des Netto-insgesamt
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund				
Citi	USA	3.749	3.749	0,73
JP Morgan	USA	3.855	3.855	0,76
		7.604	7.604	1,49

Differenzkontrakte

Gegenpartei	Gründungsland	Gesamt-Brutto-Nominalwert (Tsd.) EUR	Absoluter beizulegender Zeitwert (in Tsd.) EUR	% des Netto-insgesamt
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^				
UBS	Schweiz	104.460	8.813	3,84
		104.460	8.813	3,84

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 2019 aufgeführt:

Fonds	Emittent der Sicherheit*	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Vereinigte Staaten**	US-Dollar	USD 91.068

* Wenn zum 31. August 2019 weniger als zehn Emittenten von Sicherheiten vorhanden waren, wurden alle Emittenten aufgenommen.

** Die zugrunde liegenden Anleihen und Schuldtitel, die als Sicherheit gehalten werden, werden vom United States Treasury begeben.

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Art und der Qualität der erhaltenen unbaren Sicherheiten zum 31. August 2019:

Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen	Investment-Grade	USD 91.068

Die nachfolgende Laufzeitanalyse basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitstermin der umgekehrten Pensionsgeschäfte, Total Return Swaps und Differenzkontrakte und der zugehörigen erhaltenen/gestellten Sicherheiten zum 31. August 2019.

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.)	Mehr als 1 Jahr (in Tsd.)	Offene Laufzeit (in Tsd.)	Insgesamt (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Pensionsgeschäfte	–	USD 89.400	–	–	–		–	USD 89.400
	Erhaltene unbare Sicherheiten	–	–	–	–	–	USD 91.068	–	USD 91.068
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Total Return Swaps	–	–	–	–	–	USD 7.604	–	USD 7.604
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	Differenzkontrakte	–	–	–	–	–		–EUR 1.557	EUR 1.557
	Bereitgestellte bare Sicherheiten	EUR (24.746)	–	–	–	–		–	– EUR (24.746)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte im Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund sind Dreiparteien-Vereinbarungen. Die vom Fonds für die offenen umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. August 2019 erhaltenen Sicherheiten werden bei The Bank of New York Mellon auf getrennten Konten im Namen der Gesellschaft gehalten. Erhaltene Sicherheiten werden nicht weiterverwendet.

Das umgekehrte Pensionsgeschäft im Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund wird auf bilateraler Basis abgewickelt. In Bezug auf das offene umgekehrte Pensionsgeschäft erhaltene Sicherheiten werden zum 31. August 2019 bei der Verwahrstelle auf einem getrennten Konto im Namen des betreffenden Fonds gehalten. Erhaltene Sicherheiten werden nicht weiterverwendet.

Total Return Swaps und Differenzkontrakte werden bilateral abgewickelt. Es gibt zum 31. August 2019 keine in Bezug auf offene Total Return Swap-Positionen bereitgestellte oder erhaltene Sicherheiten. In Bezug auf offene Differenzkontrakt-Positionen an die Gegenpartei gestellte Sicherheiten werden zum 31. August 2019 von der Gegenpartei auf getrennten Konten gehalten.

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

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

LEGG MASON
GLOBAL ASSET MANAGEMENT