

METZLER

Asset Management

Halbjahresbericht

zum 28. Februar 2022

Metzler Asset Management GmbH

Metzler Wertsicherungsfonds 93

ungeprüft

| | |
|--------------------|---|
| Inhaltsverzeichnis | 1 |
|--------------------|---|

| | |
|--|----|
| Halbjahresbericht | 2 |
| OGAW-Sondervermögen | |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 | 2 |
| Wichtige Informationen für die Anteilhaber des OGAW-Sondervermögens | 12 |
| Weitere Informationen | 13 |

2 Metzler Wertsicherungsfonds 93 Halbjahresbericht

Vermögensübersicht zum 28. Februar 2022

| Anlageschwerpunkte | Tageswert in EUR | % Anteil am Fondsvermögen |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | 269.378.495,88 | 100,04 |
| 1. Anleihen | 257.364.781,60 | 95,58 |
| < 1 Jahr | 67.319.180,00 | 25,00 |
| >= 1 Jahr bis < 3 Jahre | 99.948.193,60 | 37,12 |
| >= 3 Jahre bis < 5 Jahre | 85.951.168,00 | 31,92 |
| >= 5 Jahre bis < 10 Jahre | 4.146.240,00 | 1,54 |
| 2. Derivate | -2.177.364,12 | -0,81 |
| 3. Bankguthaben | 10.826.661,08 | 4,02 |
| 4. Sonstige Vermögensgegenstände | 3.364.417,32 | 1,25 |
| II. Verbindlichkeiten | -107.346,39 | -0,04 |
| III. Fondsvermögen | 269.271.149,49 | 100,00 |

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2022

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 28.02.2022 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|--|--------------|---|-----------------------|---|-----------------------|------------|-----------------------|------------------------------|
| Bestandspositionen | | | | | | EUR | 257.364.781,60 | 95,58 |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | EUR | 234.859.890,60 | 87,22 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | EUR | 234.859.890,60 | 87,22 |
| 0,1780 % Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2018(2023) | DE000A14JY47 | EUR | 7.300 | 0 | 0 | % 100,818 | 7.359.714,00 | 2,73 |
| 0,1770 % Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2019(2022) | DE000A14JZE6 | EUR | 4.000 | 0 | 0 | % 100,299 | 4.011.960,00 | 1,49 |
| 0,1790 % Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2019(2023) | DE000A14JZC0 | EUR | 3.000 | 0 | 0 | % 100,684 | 3.020.520,00 | 1,12 |
| 0,3760 % Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2020(2024) | DE000A14JZQ0 | EUR | 5.600 | 0 | 0 | % 102,578 | 5.744.368,00 | 2,13 |
| 0,4720 % Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2021(2026) | DE000A14JZU2 | EUR | 2.300 | 2.300 | 0 | % 105,066 | 2.416.518,00 | 0,90 |
| 0,4770 % Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2021(2026) | DE000A14JZT4 | EUR | 7.000 | 0 | 0 | % 104,775 | 7.334.250,00 | 2,72 |
| 0,0000 % Berlin, Land FLR-Landessch.v.15(2023)A.477 | DE000A161WV0 | EUR | 4.000 | 0 | 0 | % 100,516 | 4.020.640,00 | 1,49 |
| 0,0000 % Berlin, Land FLR-Landessch.v.17(2023)A.494 | DE000A2AAPN5 | EUR | 4.500 | 0 | 0 | % 100,931 | 4.541.895,00 | 1,69 |
| 0,0000 % Berlin, Land FLR-Landessch.v.17(2024)A.491 | DE000A2AAPJ3 | EUR | 2.500 | 0 | 0 | % 101,186 | 2.529.650,00 | 0,94 |
| 0,1370 % Berlin, Land FLR-Landessch.v.20(2025)A.525 | DE000A289LB4 | EUR | 2.500 | 0 | 0 | % 102,584 | 2.564.600,00 | 0,95 |
| 0,1300 % Berlin, Land FLR-Landessch.v.20(2026)A.522 | DE000A289K89 | EUR | 4.000 | 0 | 0 | % 103,042 | 4.121.680,00 | 1,53 |
| 0,1260 % Berlin, Land FLR-Landessch.v.20(2027)A.523 | DE000A289K97 | EUR | 4.000 | 0 | 0 | % 103,656 | 4.146.240,00 | 1,54 |
| 0,1700 % Berlin, Land FLR-Landessch.v.21(2026)A.534 | DE000A3H2Y40 | EUR | 4.000 | 0 | 0 | % 103,795 | 4.151.800,00 | 1,54 |
| 0,7500 % Berlin, Land Landessch.v.2015(2023)Ausg.474 | DE000A161WS6 | EUR | 4.500 | 0 | 0 | % 101,524 | 4.568.580,00 | 1,70 |
| 0,0000 % Brandenburg, Land FLR-Schatzanw.v.17(22) | DE000A2AAWE0 | EUR | 7.000 | 0 | 0 | % 100,440 | 7.030.800,00 | 2,61 |
| 0,1720 % Brandenburg, Land FLR-Schatzanw.v.21(25) | DE000A3E5SH3 | EUR | 4.000 | 4.000 | 0 | % 102,727 | 4.109.080,00 | 1,53 |
| 0,1370 % European Investment Bank EO-FLR Med.-Term Nts 2018(23) | XS1795353199 | EUR | 2.280 | 0 | 0 | % 100,982 | 2.302.389,60 | 0,86 |
| 0,2330 % Hamburg, Freie und Hansestadt FLR-LandSchatzanw.A.1 20(26) | DE000A2LQPA5 | EUR | 8.500 | 1.500 | 0 | % 102,991 | 8.754.235,00 | 3,25 |
| 0,3790 % Hamburg, Freie und Hansestadt FLR-LandSchatzanw.A.1 21(27) | DE000A2LQPG2 | EUR | 4.000 | 0 | 0 | % 104,705 | 4.188.200,00 | 1,56 |
| 0,4420 % Hamburg, Freie und Hansestadt FLR-LandSchatzanw.A.1 22(27) | DE000A2LQPM0 | EUR | 5.300 | 5.300 | 0 | % 105,006 | 5.565.318,00 | 2,07 |
| 0,0000 % Hamburg, Freie und Hansestadt FLR-LandSchatzanw.A.4 18(23) | DE000A1685Y4 | EUR | 5.000 | 0 | 0 | % 101,007 | 5.050.350,00 | 1,88 |
| 0,1710 % Hamburg, Freie und Hansestadt FLR-LandSchatzanw.A.5 19(23) | DE000A2LQN95 | EUR | 4.000 | 0 | 0 | % 101,289 | 4.051.560,00 | 1,50 |
| 0,0000 % Investitionsbank Berlin FLR-IHS Ser.150 v.14(22) | DE000A11QH42 | EUR | 7.000 | 0 | 0 | % 100,253 | 7.017.710,00 | 2,61 |
| 0,4270 % Investitionsbank Berlin FLR-IHS Ser.211 v.20(22) | DE000A2YN082 | EUR | 9.000 | 0 | 0 | % 100,802 | 9.072.180,00 | 3,37 |
| 0,9770 % Investitionsbank Berlin FLR-IHS Ser.212 v.21(25) | DE000A2YN090 | EUR | 8.000 | 0 | 0 | % 105,718 | 8.457.440,00 | 3,14 |
| 0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau FLR-MTN v.2018(2023) | DE000A2GSNU4 | EUR | 5.000 | 0 | 0 | % 100,610 | 5.030.500,00 | 1,87 |
| 0,4520 % L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR-IHS S.3156 v.19(22) | DE000A2E4UH3 | EUR | 5.000 | 0 | 0 | % 100,306 | 5.015.300,00 | 1,86 |
| 0,3980 % L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR-IHS S.3157 v.19(22) | DE000A2E4UJ9 | EUR | 3.000 | 0 | 0 | % 100,043 | 3.001.290,00 | 1,11 |
| 0,9970 % L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR-IHS S.3158 v.20(23) | DE000A2E4UK7 | EUR | 7.500 | 0 | 0 | % 102,268 | 7.670.100,00 | 2,85 |
| 0,9540 % L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR-IHS S.3160 v.20(23) | DE000A2E4UM3 | EUR | 5.000 | 0 | 0 | % 102,789 | 5.139.450,00 | 1,91 |

4 Metzler Wertsicherungsfonds 93 Halbjahresbericht

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2022

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 28.02.2022 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|--------------|---|-----------------------|---|-----------------------|------------|-----------------------|------------------------------|
| 1,4240 % L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR-IHS S.3170 v.21(26) | DE000A3KK5Z2 | EUR | 4.700 | 1.700 | 0 | % 108,458 | 5.097.526,00 | 1,89 |
| 1,2600 % L-Bank Bad.-Württ.-Förderbank FLR-IHS S.3213 v.22(26) | DE000A3MQP67 | EUR | 6.000 | 6.000 | 0 | % 107,556 | 6.453.360,00 | 2,40 |
| 2,1250 % LfA Förderbank Bayern Inh.-Schv.R.1144 v.14(24) | DE000LFA1446 | EUR | 4.000 | 2.000 | 0 | % 104,498 | 4.179.920,00 | 1,55 |
| 1,2500 % LfA Förderbank Bayern Inh.-Schv.R.1147 v.14(24) | DE000LFA1479 | EUR | 3.500 | 3.500 | 0 | % 102,970 | 3.603.950,00 | 1,34 |
| 0,2270 % NRW.BANK FLR-Inh.-Schv.A.17U v.17(22) | DE000NWB17U2 | EUR | 5.000 | 0 | 0 | % 100,167 | 5.008.350,00 | 1,86 |
| 0,2210 % NRW.BANK FLR-Inh.-Schv.A.17Z v.17(23) | DE000NWB17Z1 | EUR | 4.300 | 0 | 0 | % 101,179 | 4.350.697,00 | 1,62 |
| 0,2070 % NRW.BANK FLR-MTN-IHS Ausg.2JE v.18(23) | DE000NWB2JE3 | EUR | 8.000 | 900 | 0 | % 100,716 | 8.057.280,00 | 2,99 |
| 0,8950 % Rheinland-Pfalz, Land FLR-Landessch.v.2020(2022) | DE000RLP1213 | EUR | 7.500 | 0 | 0 | % 100,842 | 7.563.150,00 | 2,81 |
| 0,9580 % Rheinland-Pfalz, Land FLR-Landessch.v.2020(2023) | DE000RLP1239 | EUR | 7.000 | 0 | 0 | % 101,976 | 7.138.320,00 | 2,65 |
| 1,4700 % Rheinland-Pfalz, Land FLR-Landessch.v.2021(2024) | DE000RLP1296 | EUR | 9.000 | 0 | 0 | % 104,361 | 9.392.490,00 | 3,49 |
| 0,9660 % Rheinland-Pfalz, Land FLR-Landessch.v.2021(2024) | DE000RLP1312 | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % 103,773 | 2.075.460,00 | 0,77 |
| 0,1620 % Saarland, Land FLR-Landesschatz.R.2 v. 21(25) | DE000A289KC4 | EUR | 7.000 | 0 | 0 | % 102,493 | 7.174.510,00 | 2,66 |
| 0,1710 % Saarland, Land FLR-Landesschatz.R.3 v. 21(26) | DE000A289KD2 | EUR | 8.000 | 8.000 | 0 | % 103,457 | 8.276.560,00 | 3,07 |
| 0,0000 % Schleswig-Holstein, Land FLR-Landesschatz.v.16(22) A.1 | DE000SHFM519 | EUR | 4.500 | 0 | 0 | % 100,000 | 4.500.000,00 | 1,67 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | | | EUR | 22.504.891,00 | 8,36 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | EUR | 22.504.891,00 | 8,36 |
| 0,1280 % Investitionsbank Schleswig-Hol FLR-IHS Ser.16 v.20(25) | DE000A2TR158 | EUR | 7.100 | 0 | 0 | % 102,621 | 7.286.091,00 | 2,71 |
| 0,1490 % Investitionsbank Schleswig-Hol FLR-IHS Ser.17 v.20(24) | DE000A2TR166 | EUR | 8.000 | 3.000 | 0 | % 101,931 | 8.154.480,00 | 3,03 |
| 0,0000 % Investitionsbank Schleswig-Hol FLR-IHS v.20(23) | DE000A2TR133 | EUR | 4.000 | 1.500 | 0 | % 100,693 | 4.027.720,00 | 1,50 |
| 0,0000 % Investitionsbank Schleswig-Hol FLR-IHS v.20(24) | DE000A2TR141 | EUR | 3.000 | 0 | 0 | % 101,220 | 3.036.600,00 | 1,13 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | EUR | 257.364.781,60 | 95,58 |

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2022

| Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 28.02.2022 | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens | |
|---|-------|---|-----------------------|--------------------|------------------------------|--------------|
| Derivate | | | | EUR | -2.177.364,12 | -0,81 |
| (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) | | | | | | |
| Aktienindex-Derivate | | | | EUR | -2.068.395,15 | -0,77 |
| Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | | | |
| Aktienindex-Terminkontrakte | | | | EUR | -2.068.395,15 | -0,77 |
| FUTURE SPI 200 INDEX 03.22 ASX | 226 | AUD | Anzahl 23 | -76.596,22 | -0,03 | |
| FUTURE S+P/TSX 60 INDEX 03.22 MSE | 661 | CAD | Anzahl 15 | -38.320,58 | -0,01 | |
| FUTURE SMI 03.22 EUREX | 185 | CHF | Anzahl 26 | -125.897,88 | -0,05 | |
| FUTURE EURO STOXX 50 PR.EUR 03.22 EUREX | 185 | EUR | Anzahl 158 | -410.155,00 | -0,15 | |
| FUTURE FTSE 100 INDEX 03.22 ICE | 961 | GBP | Anzahl 28 | -12.946,59 | 0,00 | |
| FUTURE HANG SENG INDEX 03.22 HKFE | 456 | HKD | Anzahl 17 | -75.456,11 | -0,03 | |
| FUTURE TOKYO STK.PR.(TOPIX) IND. 03.22 OSE | 969 | JPY | Anzahl 43 | -242.855,44 | -0,09 | |
| FUTURE E-MINI RUSS.2000 IND. 03.22 CME | 352 | USD | Anzahl 18 | -70.445,64 | -0,03 | |
| FUTURE E-MINI S+P 500 INDEX 03.22 CME | 352 | USD | Anzahl 24 | -264.437,72 | -0,10 | |
| FUTURE MINI MSCI EMERG. MARKETS INDEX 03.22 ICE | 247 | USD | Anzahl 214 | -578.174,72 | -0,21 | |
| FUTURE NASDAQ-100 E-MINI INDEX 03.22 CME | 359 | USD | Anzahl 8 | -173.109,25 | -0,06 | |
| Zins-Derivate | | | | EUR | -108.968,97 | -0,04 |
| Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | | | |
| Zinsterminkontrakte | | | | EUR | -108.968,97 | -0,04 |
| FUTURE TREASURY BOND 10Y(SYNTH.) 03.22 ASX | 226 | AUD | 4.700.000 | -112.971,64 | -0,04 | |
| FUTURE 10 Y CANADA BONDS (SYNTH.) 06.22 MSE | 661 | CAD | 5.600.000 | 25.956,61 | 0,01 | |
| FUTURE EURO-BOBL 03.22 EUREX | 185 | EUR | 2.500.000 | -19.300,00 | -0,01 | |
| FUTURE EURO-BUND 03.22 EUREX | 185 | EUR | 1.700.000 | -48.320,00 | -0,02 | |
| FUTURE LONG TERM EURO OAT 03.22 EUREX | 185 | EUR | 1.300.000 | -54.790,00 | -0,02 | |
| FUTURE LONG GILT (SYNTH.) 06.22 ICE | 961 | GBP | 3.100.000 | 24.160,59 | 0,01 | |
| FUTURE 10Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.22 CBOT | 362 | USD | 5.000.000 | 36.895,65 | 0,01 | |
| FUTURE 5Y TREASURY NOTE (SYNTH.) 06.22 CBOT | 362 | USD | 7.800.000 | 39.399,82 | 0,01 | |

6 Metzler Wertsicherungsfonds 93 Halbjahresbericht

Vermögensaufstellung zum 28. Februar 2022

| Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 28.02.2022 | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|---|-----------------------|------------|-----------------------|------------------------------|
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | EUR | 10.826.661,08 | 4,02 |
| Bankguthaben | | | EUR | 10.826.661,08 | 4,02 |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | |
| B. Metzler seel Sohn & Co. AG | EUR | 5.025.610,69 | % 100,000 | 5.025.610,69 | 1,87 |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei: | | | | | |
| B. Metzler seel Sohn & Co. AG | AUD | 1.248.165,71 | % 100,000 | 806.621,25 | 0,30 |
| B. Metzler seel Sohn & Co. AG | CAD | 852.871,15 | % 100,000 | 598.800,22 | 0,22 |
| B. Metzler seel Sohn & Co. AG | CHF | 682.704,57 | % 100,000 | 662.691,29 | 0,25 |
| B. Metzler seel Sohn & Co. AG | GBP | 303.057,38 | % 100,000 | 362.118,99 | 0,13 |
| B. Metzler seel Sohn & Co. AG | HKD | 4.352.947,67 | % 100,000 | 496.045,45 | 0,18 |
| B. Metzler seel Sohn & Co. AG | JPY | 115.117.778,00 | % 100,000 | 890.066,18 | 0,33 |
| B. Metzler seel Sohn & Co. AG | USD | 2.229.024,45 | % 100,000 | 1.984.707,01 | 0,74 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | EUR | 3.364.417,32 | 1,25 |
| Zinsansprüche | EUR | 236.959,09 | | 236.959,09 | 0,09 |
| Einschüsse (Initial Margins) | EUR | 3.127.458,23 | | 3.127.458,23 | 1,16 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | EUR | -107.346,39 | -0,04 |
| Zinsverbindlichkeiten | EUR | -5.858,78 | | -5.858,78 | 0,00 |
| Verwaltungsvergütung | EUR | -87.247,54 | | -87.247,54 | -0,03 |
| Verwahrstellenvergütung | EUR | -10.331,91 | | -10.331,91 | 0,00 |
| Lagerstellenkosten | EUR | -3.908,16 | | -3.908,16 | 0,00 |
| Fondsvermögen | | | EUR | 269.271.149,49 | 100,00¹⁾ |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 A | | | | | |
| Anteilwert | | | EUR | 116,92 | |
| Ausgabepreis | | | EUR | 121,01 | |
| Rücknahmepreis | | | EUR | 116,92 | |
| Anzahl Anteile | | | STK | 197.493 | |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 B | | | | | |
| Anteilwert | | | EUR | 114,30 | |
| Ausgabepreis | | | EUR | 114,30 | |
| Rücknahmepreis | | | EUR | 114,30 | |
| Anzahl Anteile | | | STK | 233.703 | |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 C | | | | | |
| Anteilwert | | | EUR | 118,23 | |
| Ausgabepreis | | | EUR | 118,23 | |
| Rücknahmepreis | | | EUR | 118,23 | |
| Anzahl Anteile | | | STK | 1.856.321 | |

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

| | | per 28.02.2022 | |
|-----|-------|----------------|---------------|
| AUD | (AUD) | 1,5474000 | = 1 EUR (EUR) |
| CAD | (CAD) | 1,4243000 | = 1 EUR (EUR) |
| CHF | (CHF) | 1,0302000 | = 1 EUR (EUR) |
| GBP | (GBP) | 0,8369000 | = 1 EUR (EUR) |
| HKD | (HKD) | 8,7753000 | = 1 EUR (EUR) |
| JPY | (JPY) | 129,3362000 | = 1 EUR (EUR) |
| USD | (USD) | 1,1231000 | = 1 EUR (EUR) |

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

| | |
|-----|--------------------------|
| 185 | Eurex Deutschland |
| 226 | Sydney – ASX–Fut. + Opt. |
| 247 | New York – ICE Fut. U.S. |
| 352 | Chicago – CME Globex |
| 359 | Chicago Merc. Ex. |
| 362 | Chicago Board of Trade |
| 456 | Hongkong – HKFE |
| 661 | Montreal Exch.–Fut./Opt. |
| 961 | London – ICE Fut. Europe |
| 969 | Osaka Exchange F.+O. |

8 Metzler Wertsicherungsfonds 93 Halbjahresbericht

**Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:
– Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzugang zum Berichtsstichtag):**

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000 | Käufe bzw. Zugänge | Verkäufe bzw. Abgänge | Volumen in 1.000 |
|--|--------------|-------------------------------------|-----------------------|--------------------------|---------------------|
| Nichtnotierte Wertpapiere ¹⁾ | | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | |
| 0,1880 % Baden-Württemberg, Land FLR-LSA.v.2017(2021) | DE000A14JY39 | EUR | 0 | 5.000 | |
| 0,0000 % Berlin, Land FLR-Landessch.v.13(2021)A.411 | DE000A1TNF42 | EUR | 0 | 1.000 | |
| 0,0000 % Brandenburg, Land FLR-Schatzanw.v.16(21) | DE000A2AAWC4 | EUR | 0 | 5.700 | |
| 0,0000 % Nordrhein-Westfalen, Land FLR-Landessch.v.09(21) R.968 | DE000NRW2YN5 | EUR | 0 | 6.000 | |
| Derivate | | | | | |
| (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe) | | | | | |
| Terminkontrakte | | | | | |
| Aktienindex-Terminkontrakte | | | | | |
| Gekaufte Kontrakte: | | | | | |
| (Basiswert(e): ESTX 50 PR.EUR, FTSE 100, HANG SENG, MSCI EMERG. MARKETS, NASDAQ-100, RUSSELL 2000, S+P 500, S+P/ASX 200, S+P/TSX 60 PR CAD, SMI PR CHF, TOPIX PR JPY) | | | | | |
| | | EUR | | | 188.160,32 |
| Zinsterminkontrakte | | | | | |
| Gekaufte Kontrakte: | | | | | |
| (Basiswert(e): 10Y.AUST.COMM.TR.BD.SY.AN., 10Y.CANADA GOV.BD.SYN.AN., 10Y.US TRE.NT.SYN.AN., 5Y.US TRE.NT.SYN.AN., 8,5-10,5Y.FR.GO.GB.SYN.AN, BRITISCH LO. GILT SYN.AN., EURO-BOBL, EURO-BUND) | | | | | |
| | | EUR | | | 221.117,81 |
| Verkaufte Kontrakte: | | | | | |
| (Basiswert(e): 10Y.US TRE.NT.SYN.AN., 5Y.US TRE.NT.SYN.AN.) | | | | | |
| | | EUR | | | 2.070,27 |

1) Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

Anteilklassenmerkmale im Überblick

Erstausgabedatum

| | |
|----------------------------------|-------------------|
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 A | 3. März 2008 |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 B | 3. September 2012 |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 C | 3. September 2012 |

Erstausgabepreise

| | |
|----------------------------------|-------------------------------------|
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 A | 103,50 EUR (inkl. Ausgabeaufschlag) |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 B | 100,00 EUR (inkl. Ausgabeaufschlag) |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 C | 100,00 EUR (inkl. Ausgabeaufschlag) |

Ausgabeaufschlag¹⁾

(berechnet auf den Anteilwert / vom Anteilinhaber zu tragen)

| | |
|----------------------------------|--------|
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 A | 3,50 % |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 B | 0,00 % |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 C | 0,00 % |

Rücknahmeabschlag

(vom Anteilinhaber zu tragen)

| | |
|----------------------------------|----------|
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 A | entfällt |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 B | entfällt |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 C | entfällt |

Mindestanlagesumme

| | |
|----------------------------------|---|
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 A | keine |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 B | 5.000,00 EUR (Erstmindestanlagesumme) |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 C | 500.000,00 EUR (Erstmindestanlagesumme) |

Verwaltungsvergütung²⁾

| | |
|----------------------------------|-------------|
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 A | 0,90 % p.a. |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 B | 0,60 % p.a. |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 C | 0,35 % p.a. |

Verwahrstellenvergütung³⁾

| | |
|----------------------------------|-------------|
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 A | 0,05 % p.a. |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 B | 0,05 % p.a. |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 C | 0,05 % p.a. |

Vertriebsweg

| | |
|--------------------------------------|---|
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 A | nicht einschlägig |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 B + C | wird bei der Orderstelle eine Sammelorder aufgegeben, wird die Anlagesumme der Einzelorders kumuliert betrachtet |

Währung

| | |
|----------------------------------|-----|
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 A | EUR |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 B | EUR |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 C | EUR |

Ertragsverwendung

| | |
|----------------------------------|---------------|
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 A | Thesaurierung |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 B | Thesaurierung |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 C | Thesaurierung |

Wertpapier-Kennnummer / ISIN:

| | |
|----------------------------------|-----------------------|
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 A | A0MY0U / DE000A0MY0U9 |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 B | A1JSXR / DE000A1JSXR5 |
| Metzler Wertsicherungsfonds 93 C | A0H1AG / DE000A0H1AG2 |

1) Der maximale Ausgabeaufschlag beträgt 5,00%

2) Die maximale Verwaltungsvergütung beträgt 1,60%

3) Die maximale Verwahrstellenvergütung beträgt 0,12%

10 Metzler Wertsicherungsfonds 93 Halbjahresbericht

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) **95,58**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) **-0,81**

Sonstige Angaben

Metzler Wertsicherungsfonds 93 A

| | | |
|----------------|-----|---------|
| Anteilwert | EUR | 116,92 |
| Ausgabepreis | EUR | 121,01 |
| Rücknahmepreis | EUR | 116,92 |
| Anzahl Anteile | STK | 197.493 |

Metzler Wertsicherungsfonds 93 B

| | | |
|----------------|-----|---------|
| Anteilwert | EUR | 114,30 |
| Ausgabepreis | EUR | 114,30 |
| Rücknahmepreis | EUR | 114,30 |
| Anzahl Anteile | STK | 233.703 |

Metzler Wertsicherungsfonds 93 C

| | | |
|----------------|-----|-----------|
| Anteilwert | EUR | 118,23 |
| Ausgabepreis | EUR | 118,23 |
| Rücknahmepreis | EUR | 118,23 |
| Anzahl Anteile | STK | 1.856.321 |

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Die nachfolgend dargestellten Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände decken eventuelle aus der Covid-19 Pandemie resultierenden Marktauswirkungen ab. Darüber hinausgehende Bewertungsanpassungen waren nicht erforderlich.

Für Devisen, Aktien, Anleihen und Derivate, die zum Handel an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, wird der letzte verfügbare handelbare Kurs gemäß § 27 KARBV zugrunde gelegt. Für Renten mit einem Poolfaktor werden die Kurse nicht um den Poolfaktor bereinigt, nur der Kurswert wird bereinigt ausgewiesen.

Für Renten mit einem Inflationsanteil werden die Kurse nicht um den Inflationsfaktor bereinigt, nur der Kurswert wird bereinigt ausgewiesen.

Für Investmentanteile werden die aktuellen Werte, für Bankguthaben und Verbindlichkeiten der Nennwert bzw. Rückzahlungsbetrag gemäß § 29 KARBV zugrunde gelegt.

Für Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an einer Börse noch an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in den regulierten Markt oder Freiverkehr einer Börse einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden gemäß § 28 KARBV i.V.m. § 168 Absatz 3 KAGB die Verkehrswerte zugrunde gelegt, die sich bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten ergeben.

Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

Grundsätze ordnungsmäßiger Buchführung

Bei Ansatz und Bewertung der sonstigen Vermögensgegenstände, Verbindlichkeiten und Rückstellungen beachtet die KVG den Grundsatz der intertemporalen Anlegergerechtigkeit. Die Anwendung dieses Grundsatzes soll die Gleichbehandlung der Anleger unabhängig von deren Ein- bzw. Austrittszeitpunkt sicherstellen.

Die KVG wendet die formellen Grundsätze ordnungsmäßiger Buchführung an, soweit sich aus dem KAGB, der KARBV und der Verordnung (EU) Nr. 231/2013 nichts anderes ergibt.

Insbesondere wendet sie den Grundsatz der periodengerechten Erfolgsermittlung an. Danach werden Aufwendungen und Erträge grundsätzlich über die Zuführung zu den Verbindlichkeiten bzw. Forderungen periodengerecht abgegrenzt und im Rechnungswesen des Sondervermögens im Geschäftsjahr der wirtschaftlichen Verursachung und unabhängig von den Zeitpunkten der entsprechenden Aufwands- und Ertragszahlung erfasst. Erfolgsabgrenzungen erfolgen dabei für wesentliche Aufwendungen und Erträge. Negative Habenzinsen werden als Aufwand unter den sonstigen Aufwendungen dargestellt.

Die Ertragspositionen werden einschließlich des jeweils angefallenen Ertragsausgleichs ausgewiesen. Der Ertragsausgleich auf die Aufwendungen wird kumuliert auf den Gesamtbetrag der Aufwendungen ermittelt und unter den sonstigen Aufwendungen als Aufwandsausgleich ausgewiesen. Die KVG beachtet den Grundsatz der Bewertungsstetigkeit. Danach werden die auf den vorhergehenden Jahresabschluss angewandten Bewertungsmethoden beibehalten.

Überdies wendet die KVG grundsätzlich den Grundsatz der Einzelbewertung an, wonach alle Vermögensgegenstände, Verbindlichkeiten und Rückstellungen unabhängig voneinander zu bewerten sind; es erfolgt keine Verrechnung von Vermögensgegenständen und Schulden und keine Bildung von Bewertungseinheiten. Gleichartige Vermögensgegenstände der Liquiditätsanlage, wie z.B. Wertpapiere, dürfen zu einer Gruppe zusammengefasst und mit dem gewogenen Durchschnittswert angesetzt werden.

Frankfurt am Main, den 28. März 2022

Metzler Asset Management GmbH
Die Geschäftsführung

Wichtige Informationen für die Anteilhaber des OGAW-Sondervermögens

Änderung der „Allgemeinen Anlagebedingungen“ und „Besonderen Anlagebedingungen“ des OGAW-Sondervermögens zum 18. Februar 2022

Mit Genehmigung der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) vom 3. November 2021 wurden die Allgemeinen Anlagebedingungen und die Besonderen Anlagebedingungen für das vorgenannte OGAW-Sondervermögen geändert.

Die Allgemeinen Anlagebedingungen wurden an das neue zwischen der BaFin und dem Bundesverband Investment und Asset Management e. V. (BVI) abgestimmte Muster (Stand Juni 2021) angepasst.

Die Änderungen in den Anlagebedingungen dienen maßgeblich der Umsetzung des Fondsstandortgesetzes und der Einführung des Liquiditätsmanagement-Tools der „Rücknahmebeschränkung“ für das vorgenannte OGAW-Sondervermögen. Dazu wurde in den Besonderen Anlagebedingungen die neue Klausel zur Bestimmung des Schwellenwertes für „Rücknahmebeschränkung“ für das OGAW-Sondervermögen aufgenommen.

Die Änderungen wurden im Bundesanzeiger bekanntgemacht und außerdem auf der Internetseite der Kapitalverwaltungsgesellschaft unter www.metzler.com veröffentlicht.

Der Verkaufsprospekt und die wesentlichen Anlegerinformationen (KID) sowie die geltenden Anlagebedingungen sind auf der Internetseite der Kapitalverwaltungsgesellschaft unter www.metzler.com veröffentlicht.

Kapitalverwaltungsgesellschaft

Metzler Asset Management GmbH
Untermainanlage 1
60329 Frankfurt am Main
Postfach 20 01 38
60605 Frankfurt am Main
Telefon (+49 69) 21 04-11 11

Portfoliomanagement

Metzler Asset Management GmbH
Untermainanlage 1
60329 Frankfurt am Main

Verwahrstelle

B. Metzler seel. Sohn & Co. AG
Untermainanlage 1
60329 Frankfurt am Main

Aufsichtsbehörde

Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin)
Marie-Curie-Straße 24-28
60439 Frankfurt am Main

Weitere Informationen, die wesentlichen Anlegerinformationen (KID), den Verkaufsprospekt mit den Anlagebedingungen sowie die aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte der Fonds finden Sie auf der Homepage der Kapitalverwaltungsgesellschaft: www.metzler.com. Die genannten Informationen und Unterlagen erhalten Sie zudem kostenlos bei

Metzler Asset Management GmbH
Postfach 20 01 38
60605 Frankfurt am Main
Telefon: (+49 69) 21 04 – 11 11
Telefax: (+49 69) 21 04 – 11 79

Kapitalverwaltungsgesellschaft und Kontaktadresse

Metzler Asset Management GmbH
Untermainanlage 1
60329 Frankfurt am Main
Postfach 20 01 38
60605 Frankfurt am Main
Telefon (+49 69) 21 04 – 11 11
Telefax (+49 69) 21 04 – 11 79
www.metzler.com