

Unabhängig seit 1674

METZLER

Asset Management

Halbjahresbericht

zum 31. März 2022

Metzler Asset Management GmbH

Metzler Euro Corporates Sustainability

ungeprüft

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

| | |
|--|----|
| Halbjahresbericht | 2 |
| OGAW-Sondervermögen | |
| Metzler Euro Corporates Sustainability | 2 |
| Wichtige Informationen für die Anteilhaber des OGAW Sondervermögens | 19 |
| Weitere Informationen | 20 |

2 Metzler Euro Corporates Sustainability Halbjahresbericht

Vermögensübersicht zum 31. März 2022

| Anlageschwerpunkte | Tageswert in EUR | % Anteil am Fondsvermögen |
|----------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | 334.331.547,23 | 100,04 |
| 1. Anleihen | 325.318.241,00 | 97,34 |
| < 1 Jahr | 500.445,00 | 0,15 |
| >= 1 Jahr bis < 3 Jahre | 44.328.183,00 | 13,26 |
| >= 3 Jahre bis < 5 Jahre | 84.320.999,00 | 25,23 |
| >= 5 Jahre bis < 10 Jahre | 130.542.082,00 | 39,06 |
| >= 10 Jahre | 65.626.532,00 | 19,64 |
| 2. Investmentanteile EUR | 2.857.200,00 2.857.200,00 | 0,85 0,85 |
| 3. Derivate | -312.762,23 | -0,09 |
| 4. Bankguthaben | 3.276.850,50 | 0,98 |
| 5. Sonstige Vermögensgegenstände | 3.192.017,96 | 0,96 |
| II. Verbindlichkeiten | -128.089,88 | -0,04 |
| III. Fondsvermögen | 334.203.457,35 | 100,00 |

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2022 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|--------------|---|-----------------------|---|-----------------------|------------|-----------------------|------------------------------|
| Bestandspositionen | | | | | | EUR | 328.175.441,00 | 98,20 |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | EUR | 261.418.216,50 | 78,22 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | EUR | 261.418.216,50 | 78,22 |
| 1,6080 % 2i Rete Gas S.p.A. EO-Med.-Term Notes 2017(17/27) | XS1709374497 | EUR | 1.200 | 0 | 0 | % 98,812 | 1.185.744,00 | 0,35 |
| 1,5000 % Abbott Ireland Financing DAC EO-Notes 2018(18/26) | XS1883355197 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 101,766 | 1.017.660,00 | 0,30 |
| 0,5000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Med.-T. Nts 2021(29) | XS2389343380 | EUR | 1.200 | 0 | 0 | % 91,632 | 1.099.584,00 | 0,33 |
| 0,3750 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. EO-Notes 2021(21/30) Reg.S | XS2317288301 | EUR | 1.400 | 0 | 0 | % 90,724 | 1.270.136,00 | 0,38 |
| 2,2500 % AIB Group PLC EO-M.-T.Non-Pref.Nts 18(25) | XS1849550592 | EUR | 700 | 0 | 0 | % 102,516 | 717.612,00 | 0,21 |
| 0,5000 % alstria office REIT-AG Anleihe v.2019(2019/2025) | XS2053346297 | EUR | 1.500 | 0 | 0 | % 93,943 | 1.409.145,00 | 0,42 |
| 2,7500 % Anheuser-Busch InBev N.V./S.A. EO-Medium-Term Nts 2016(16/36) | BE6285457519 | EUR | 800 | 0 | 0 | % 107,845 | 862.760,00 | 0,26 |
| 1,1500 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2018(18/27) | BE6301510028 | EUR | 550 | 0 | 900 | % 100,080 | 550.440,00 | 0,16 |
| 1,5000 % APRR EO-Medium-Term Nts 2017(17/33) | FR0013295722 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 98,397 | 983.970,00 | 0,29 |
| 3,3750 % Arountown SA EO-FLR Notes 2019(24/Und.) | XS2055106210 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 98,667 | 986.670,00 | 0,30 |
| 0,3750 % Arountown SA EO-Med.-Term Notes 2021(21/27) | XS2421195848 | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 | % 91,362 | 913.620,00 | 0,27 |
| 0,1550 % Asahi Group Holdings Ltd. EO-Notes 2020(20/24) | XS2242747181 | EUR | 3.100 | 1.100 | 0 | % 98,137 | 3.042.247,00 | 0,91 |
| 0,3360 % Asahi Group Holdings Ltd. EO-Notes 2021(21/27) | XS2328981431 | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 | % 94,033 | 940.330,00 | 0,28 |
| 5,5000 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 15(27/47) | XS1311440082 | EUR | 2.100 | 2.100 | 0 | % 112,250 | 2.357.250,00 | 0,71 |
| 1,0000 % ASTM S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2021(21/26) | XS2412267358 | EUR | 1.800 | 1.800 | 0 | % 95,733 | 1.723.194,00 | 0,52 |
| 2,4000 % AT & T Inc. EO-Notes 2014(14/24) | XS1076018131 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 103,149 | 1.031.490,00 | 0,31 |
| 1,3000 % AT & T Inc. EO-Notes 2015(15/23) | XS1196373507 | EUR | 700 | 0 | 0 | % 101,349 | 709.443,00 | 0,21 |
| 1,8000 % AT & T Inc. EO-Notes 2018(19/26) | XS1907120528 | EUR | 2.000 | 0 | 0 | % 102,481 | 2.049.620,00 | 0,61 |
| 3,1250 % Aurizon Network Pty Ltd. EO-Med.-Term Nts 2016(16/26) | XS1418788599 | EUR | 1.150 | 0 | 0 | % 106,047 | 1.219.540,50 | 0,36 |
| 2,0000 % Aurizon Network Pty Ltd. EO-Medium-Term Nts 2014(24) | XS1111428402 | EUR | 600 | 0 | 0 | % 102,620 | 615.720,00 | 0,18 |
| 1,3750 % Autoroutes du Sud de la France EO-Medium-Term Nts 2019(19/31) | FR0013404571 | EUR | 1.100 | 500 | 0 | % 99,074 | 1.089.814,00 | 0,33 |
| 1,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Med.-T.Nts 2020(25/30) | XS2104051433 | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % 97,202 | 1.944.040,00 | 0,58 |
| 3,5000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Medium-Term Notes 2017(27) | XS1562614831 | EUR | 1.100 | 0 | 0 | % 106,933 | 1.176.263,00 | 0,35 |
| 0,5000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Non-Preferred MTN 2020(27) | XS2101349723 | EUR | 1.300 | 0 | 0 | % 95,214 | 1.237.782,00 | 0,37 |
| 1,1250 % Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Preferred MTN 20(26/27) | XS2228245838 | EUR | 1.300 | 0 | 0 | % 97,342 | 1.265.446,00 | 0,38 |
| 1,6250 % Banco Santander S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(30) | XS2247936342 | EUR | 900 | 0 | 0 | % 93,450 | 841.050,00 | 0,25 |
| 1,3750 % Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(26) | XS2168647357 | EUR | 600 | 0 | 0 | % 99,966 | 599.796,00 | 0,18 |
| 0,3000 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2019(26) | XS2063247915 | EUR | 1.500 | 0 | 0 | % 95,669 | 1.435.035,00 | 0,43 |
| 0,5800 % Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2019(20/29) | XS2038039074 | EUR | 3.200 | 2.000 | 0 | % 93,089 | 2.978.848,00 | 0,89 |
| 1,0000 % Bank of Ireland Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2019(24/25) | XS2082969655 | EUR | 2.700 | 0 | 0 | % 98,455 | 2.658.285,00 | 0,80 |
| 1,2500 % Bankinter S.A. EO-FLR Notes 2021(27/32) | ES02136790F4 | EUR | 1.500 | 1.500 | 0 | % 91,709 | 1.375.635,00 | 0,41 |
| 0,8750 % Bankinter S.A. EO-Non-Pref. Obl. 2019(26) | ES0213679HN2 | EUR | 1.500 | 0 | 0 | % 96,725 | 1.450.875,00 | 0,43 |

4 Metzler Euro Corporates Sustainability Halbjahresbericht

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2022 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|--------------|---|-----------------------|---|-----------------------|-----------|--------------------|------------------------------|
| 1,2130 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl EO-Notes 2021(21/36) | XS2298459426 | EUR | 600 | 0 | 0 | % 88,225 | 529.350,00 | 0,16 |
| 3,0000 % Bertelsmann SE & Co. KGaA FLR-Sub.Anl. v.2015(2023/2075) | XS1222591023 | EUR | 1.500 | 1.500 | 0 | % 101,306 | 1.519.590,00 | 0,45 |
| 1,0000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 2022(28) | XS2447564332 | EUR | 700 | 700 | 0 | % 98,113 | 686.791,00 | 0,21 |
| 1,3750 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(29) | FR0013422011 | EUR | 1.500 | 0 | 0 | % 97,350 | 1.460.250,00 | 0,44 |
| 0,6250 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(32) | FR0014000UL9 | EUR | 1.700 | 1.000 | 0 | % 86,776 | 1.475.192,00 | 0,44 |
| 2,3750 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2014(14/24) | XS1112850125 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 103,544 | 1.035.440,00 | 0,31 |
| 0,6250 % Boston Scientific Corp. EO-Notes 2019(19/27) | XS2070192591 | EUR | 4.000 | 1.300 | 0 | % 94,209 | 3.768.360,00 | 1,13 |
| 1,4670 % BP Capital Markets B.V. EO-Bonds 2021(41) | XS2388557998 | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 | % 86,015 | 860.150,00 | 0,26 |
| 3,6250 % BP Capital Markets PLC EO-FLR Notes 2020(29/Und.) | XS2193662728 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 98,899 | 988.990,00 | 0,30 |
| 1,5730 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Notes 2015(27) | XS1190974011 | EUR | 700 | 0 | 0 | % 101,096 | 707.672,00 | 0,21 |
| 1,2310 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2019(31) | XS1992927902 | EUR | 500 | 500 | 0 | % 94,631 | 473.155,00 | 0,14 |
| 0,7500 % BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 2021(31) | FR00140027U2 | EUR | 1.700 | 0 | 0 | % 90,411 | 1.536.987,00 | 0,46 |
| 3,0000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2014(24) | XS1069549761 | EUR | 500 | 0 | 0 | % 104,501 | 522.505,00 | 0,16 |
| 1,8750 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2016(26) | XS1512677003 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 100,366 | 1.003.660,00 | 0,30 |
| 0,2500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Non-Preferred MTN 2021(28) | FR0014001I68 | EUR | 1.100 | 0 | 0 | % 91,364 | 1.005.004,00 | 0,30 |
| 0,6250 % Cadent Finance PLC EO-Med.-Term Nts 2021(21/30) | XS2320438653 | EUR | 1.550 | 0 | 0 | % 90,542 | 1.403.401,00 | 0,42 |
| 2,2500 % Caixabank S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 2018(25/30) | XS1808351214 | EUR | 1.800 | 0 | 0 | % 99,585 | 1.792.530,00 | 0,54 |
| 0,8750 % Carlsberg Breweries A/S EO-Medium-Term Nts 2019(29/29) | XS2016228087 | EUR | 1.300 | 0 | 0 | % 93,230 | 1.211.990,00 | 0,36 |
| 1,5000 % Citigroup Inc. EO-Medium-Term Nts 2016(16/28) | XS1457608286 | EUR | 1.400 | 0 | 0 | % 99,083 | 1.387.162,00 | 0,42 |
| 1,6250 % CNH Industrial Finance Euro.SA EO-Medium-Term Nts 2019(19/29) | XS2022084367 | EUR | 1.500 | 1.500 | 0 | % 97,805 | 1.467.075,00 | 0,44 |
| 1,1000 % Coca-Cola Co., The EO-Notes 2016(16/36) | XS1485643610 | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 | % 92,719 | 927.190,00 | 0,28 |
| 0,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Preferred MTN 2021(33) | XS2306851853 | EUR | 1.300 | 0 | 0 | % 89,469 | 1.163.097,00 | 0,35 |
| 4,5000 % Crédit Agricole Assurances SA EO-FLR Notes 2014(25/Und.) | FR0012222297 | EUR | 3.200 | 1.100 | 0 | % 106,841 | 3.418.912,00 | 1,02 |
| 4,2500 % Crédit Agricole Assurances SA EO-FLR Notes 2015(25/Und.) | FR0012444750 | EUR | 3.000 | 1.400 | 0 | % 105,513 | 3.165.390,00 | 0,95 |
| 1,8750 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) EO-Non-Preferred MTN 2016(26) | XS1538284230 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 101,731 | 1.017.310,00 | 0,30 |
| 1,7500 % Credit Agricole S.A. (Ldn Br.) EO-Non-Preferred MTN 2019(29) | XS1958307461 | EUR | 1.400 | 0 | 0 | % 99,928 | 1.398.992,00 | 0,42 |
| 4,0000 % Crédit Agricole S.A. EO-FLR Notes 2020(27/Und.) | FR0013533999 | EUR | 1.300 | 1.300 | 0 | % 99,419 | 1.292.447,00 | 0,39 |
| 2,0000 % Crédit Agricole S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(29) | XS1968706108 | EUR | 1.600 | 0 | 0 | % 98,809 | 1.580.944,00 | 0,47 |
| 0,6250 % Credit Suisse Group AG EO-Medium-Term Nts 2021(21/33) | CH0591979627 | EUR | 500 | 0 | 0 | % 81,392 | 406.960,00 | 0,12 |
| 1,8750 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.22(27/28) | DE000DL19WL7 | EUR | 1.400 | 1.400 | 0 | % 98,568 | 1.379.952,00 | 0,41 |
| 0,1250 % Deutsche Börse AG Anleihe v.21(21/31) | DE000A3H2465 | EUR | 700 | 0 | 0 | % 89,825 | 628.775,00 | 0,19 |
| 1,2500 % Deutsche Post AG Medium Term Notes v.16(26/26) | XS1388661735 | EUR | 1.150 | 0 | 0 | % 101,288 | 1.164.812,00 | 0,35 |
| 1,5000 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 2016(28) | XS1382791975 | EUR | 1.900 | 0 | 0 | % 101,447 | 1.927.493,00 | 0,58 |

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2022 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|--------------|---|-----------------------|---|-----------------------|-----------|--------------------|------------------------------|
| 0,2500 % DNB Bank ASA EO-FLR Non-Pref. MTN 21(28/29) | XS2306517876 | EUR | 1.800 | 0 | 0 | % 91,176 | 1.641.168,00 | 0,49 |
| 0,7500 % DSV Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/33) | XS2360881549 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 87,857 | 878.570,00 | 0,26 |
| 1,8750 % EDP Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/29) | XS2459544339 | EUR | 700 | 700 | 0 | % 100,376 | 702.632,00 | 0,21 |
| 3,3750 % Electricité de France (E.D.F.) EO-FLR Notes 20(20/Und.) | FR0013534336 | EUR | 1.400 | 0 | 0 | % 90,257 | 1.263.598,00 | 0,38 |
| 4,0000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-FLR Notes 2018(24/Und.) | FR0013367612 | EUR | 1.500 | 1.500 | 0 | % 100,068 | 1.501.020,00 | 0,45 |
| 1,0000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 2016(16/26) | FR0013213295 | EUR | 2.200 | 0 | 0 | % 99,223 | 2.182.906,00 | 0,65 |
| 2,7500 % Elia Group E O-FLR Nts 2018(23/Und.) | BE0002597756 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 101,942 | 1.019.420,00 | 0,31 |
| 1,1250 % EnBW Energie Baden-Württem. AG FLR-Anleihe v.19(24/79) | XS2035564975 | EUR | 1.800 | 800 | 0 | % 95,697 | 1.722.546,00 | 0,52 |
| 0,2500 % EnBW International Finance BV EO-Medium-Term Nts 2020(30/30) | XS2242728041 | EUR | 700 | 700 | 0 | % 87,408 | 611.856,00 | 0,18 |
| 1,1250 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Med.-Term Notes 2018(18/26) | XS1750986744 | EUR | 2.200 | 0 | 0 | % 99,373 | 2.186.206,00 | 0,65 |
| 3,3750 % ENEL S.p.A. EO-FLR Cap. Secs 2018(26/UN) | XS1713463559 | EUR | 1.300 | 800 | 0 | % 101,778 | 1.323.114,00 | 0,40 |
| 1,8750 % Engie S.A. EO-FLR Notes 2021(21/Und.) | FR00140046Y4 | EUR | 1.200 | 0 | 0 | % 87,498 | 1.049.976,00 | 0,31 |
| 2,6250 % ENI S.p.A. EO-FLR Nts 2020(25/Und.) | XS2242929532 | EUR | 600 | 0 | 0 | % 99,354 | 596.124,00 | 0,18 |
| 2,7500 % ENI S.p.A. EO-FLR Nts 2021(30/Und.) | XS2334857138 | EUR | 600 | 0 | 0 | % 90,496 | 542.976,00 | 0,16 |
| 1,2500 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2020(26) | XS2176783319 | EUR | 700 | 0 | 0 | % 99,349 | 695.443,00 | 0,21 |
| 0,6250 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2020(30) | XS2107315470 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 90,386 | 903.860,00 | 0,27 |
| 2,0450 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2019(19/28) | XS2062490649 | EUR | 400 | 0 | 0 | % 81,948 | 327.792,00 | 0,10 |
| 1,8160 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2021(21/31) | XS2304675791 | EUR | 700 | 700 | 0 | % 80,739 | 565.173,00 | 0,17 |
| 1,0000 % Erste Group Bank AG EO-FLR Med.-T. Nts 2019(25/30) | XS2083210729 | EUR | 600 | 0 | 0 | % 95,360 | 572.160,00 | 0,17 |
| 0,2500 % Erste Group Bank AG EO-Pref. Med.-T.Nts 21(31) | AT0000A2N837 | EUR | 1.400 | 500 | 0 | % 87,282 | 1.221.948,00 | 0,37 |
| 0,3750 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/27) | FR0013463668 | EUR | 1.600 | 0 | 0 | % 95,727 | 1.531.632,00 | 0,46 |
| 0,7500 % EssilorLuxottica S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/31) | FR0013463676 | EUR | 500 | 0 | 0 | % 93,655 | 468.275,00 | 0,14 |
| 0,0000 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) EO-Med.-Term Notes 2021(24/24) | XS2332254015 | EUR | 500 | 0 | 0 | % 98,183 | 490.915,00 | 0,15 |
| 0,5000 % FCA Bank S.p.A. (Irish Branch) EO-Med.-Term Nts 2019(24/24) | XS2051914963 | EUR | 2.300 | 200 | 0 | % 98,909 | 2.274.907,00 | 0,68 |
| 1,6250 % Gecina S.A. EO-Med.-Term Nts 2018(18/30) | FR0013322989 | EUR | 800 | 0 | 0 | % 99,178 | 793.424,00 | 0,24 |
| 0,8750 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Nts 2020(30) | XS2107332640 | EUR | 1.800 | 0 | 0 | % 91,987 | 1.655.766,00 | 0,50 |
| 6,0000 % Gothaer Allgem.Versicherung AG FLR-Nachr.-Anl. v.15(25/45) | DE000A168478 | EUR | 1.500 | 1.500 | 0 | % 106,526 | 1.597.890,00 | 0,48 |
| 1,5000 % Grand City Properties S.A. EO-FLR Med-T. Nts 20(21/UND.) | XS2271225281 | EUR | 900 | 0 | 0 | % 89,033 | 801.297,00 | 0,24 |
| 0,2500 % H&M Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) | XS2303070911 | EUR | 1.500 | 0 | 0 | % 88,775 | 1.331.625,00 | 0,40 |
| 0,2500 % Heimstaden Bostad Treasury B.V EO-Medium-Term Nts 2021(21/24) | XS2397239000 | EUR | 1.600 | 1.600 | 0 | % 97,121 | 1.553.936,00 | 0,46 |
| 1,6250 % Heimstaden Bostad Treasury B.V EO-Medium-Term Nts 2021(21/31) | XS2397252011 | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 | % 88,176 | 881.760,00 | 0,26 |
| 0,6410 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2021(21/29) | XS2388491289 | EUR | 900 | 0 | 0 | % 92,263 | 830.367,00 | 0,25 |
| 3,1250 % HSBC Holdings PLC EO-Medium-Term Notes 2016(28) | XS1428953407 | EUR | 600 | 0 | 0 | % 105,013 | 630.078,00 | 0,19 |

6 Metzler Euro Corporates Sustainability Halbjahresbericht

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2022 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|--------------|---|-----------------------|---|-----------------------|-----------|--------------------|------------------------------|
| 1,0000 % Icade S.A. EO-Obl. 2022(22/30) | FR0014007NF1 | EUR | 1.500 | 1.500 | 0 | % 93,072 | 1.396.080,00 | 0,42 |
| 0,8750 % Icade Sante SAS EO-Obl. 2019(19/29) | FR0013457967 | EUR | 1.500 | 1.500 | 0 | % 93,016 | 1.395.240,00 | 0,42 |
| 1,2500 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(26/27) | XS2443920249 | EUR | 1.300 | 1.300 | 0 | % 98,824 | 1.284.712,00 | 0,38 |
| 1,0000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 19(25/30) | XS2079079799 | EUR | 2.500 | 1.500 | 0 | % 96,123 | 2.403.075,00 | 0,72 |
| 2,5000 % Inmobiliaria Colonial SOCIMI EO-Medium-Term Nts 2017(17/29) | XS1725678194 | EUR | 1.500 | 0 | 0 | % 102,240 | 1.533.600,00 | 0,46 |
| 2,0000 % Inmobiliaria Colonial SOCIMI EO-Medium-Term Nts 2018(18/26) | XS1808395930 | EUR | 500 | 0 | 0 | % 101,450 | 507.250,00 | 0,15 |
| 5,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2019(24/29) | XS1958656552 | EUR | 1.500 | 1.500 | 0 | % 106,790 | 1.601.850,00 | 0,48 |
| 3,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR NTS. 2020(25/Und.) | XS2124979753 | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % 94,064 | 1.881.280,00 | 0,56 |
| 3,9280 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2014(26) | XS1109765005 | EUR | 500 | 0 | 0 | % 104,742 | 523.710,00 | 0,16 |
| 1,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2019(29) | XS2022424993 | EUR | 900 | 0 | 0 | % 98,162 | 883.458,00 | 0,26 |
| 1,1250 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2016(16/24) | XS1375841233 | EUR | 500 | 0 | 0 | % 101,094 | 505.470,00 | 0,15 |
| 0,3000 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2020(20/28) | XS2115091717 | EUR | 2.400 | 700 | 0 | % 94,692 | 2.272.608,00 | 0,68 |
| 0,6500 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2020(20/32) | XS2115091808 | EUR | 1.200 | 1.200 | 0 | % 91,874 | 1.102.488,00 | 0,33 |
| 1,8000 % Intl Flavors & Fragrances Inc. EO-Notes 2018(18/26) | XS1843459782 | EUR | 4.800 | 1.300 | 0 | % 100,276 | 4.813.248,00 | 1,44 |
| 1,0470 % JPMorgan Chase & Co. EO-FLR Med.-T. Nts 2019(19/32) | XS2075811948 | EUR | 2.200 | 500 | 0 | % 92,515 | 2.035.330,00 | 0,61 |
| 1,9630 % JPMorgan Chase & Co. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(22/30) | XS2461234622 | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 | % 100,696 | 1.006.960,00 | 0,30 |
| 1,6250 % KBC Groep N.V. EO-FLR Med.-T.Nts 2017(24/29) | BE0002290592 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 99,495 | 994.950,00 | 0,30 |
| 0,1250 % KBC Groep N.V. EO-FLR Med.-T.Nts 2020(25/26) | BE0002728096 | EUR | 2.000 | 0 | 1.100 | % 95,727 | 1.914.540,00 | 0,57 |
| 0,6250 % Koninklijke DSM N.V. EO-Medium-Term Nts 2020(20/32) | XS2193979254 | EUR | 1.200 | 0 | 0 | % 89,756 | 1.077.072,00 | 0,32 |
| 1,2500 % LEG Immobilien SE Anleihe v.2017(2017/2024) | XS1554456613 | EUR | 1.300 | 0 | 0 | % 100,388 | 1.305.044,00 | 0,39 |
| 0,7500 % LEG Immobilien SE Medium Term Notes v.21(21/31) ¹⁾ | DE000A3E5VK1 | EUR | 1.100 | 100 | 600 | % 87,548 | 963.028,00 | 0,29 |
| 3,5000 % Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2020(25/26) | XS2148623106 | EUR | 2.400 | 2.400 | 0 | % 105,902 | 2.541.648,00 | 0,76 |
| 2,3750 % Louis Dreyfus Company Fin.B.V. EO-Notes 2020(20/25) | XS2264074647 | EUR | 2.000 | 2.000 | 0 | % 100,629 | 2.012.580,00 | 0,60 |
| 1,5000 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2019(19/39) | XS2020670936 | EUR | 900 | 0 | 0 | % 91,644 | 824.796,00 | 0,25 |
| 1,3750 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2020(20/40) | XS2238792332 | EUR | 1.200 | 0 | 0 | % 88,938 | 1.067.256,00 | 0,32 |
| 1,1250 % Mercedes-Benz Group AG Medium Term Notes v.19(34) | DE000A2YNYZ4 | EUR | 1.700 | 0 | 0 | % 92,035 | 1.564.595,00 | 0,47 |
| 1,6250 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.2019(2024/2079) | XS2011260531 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 99,968 | 999.680,00 | 0,30 |
| 0,4950 % Morgan Stanley EO-FLR M.-Term Nts 2020(21/29) | XS2250008245 | EUR | 1.700 | 0 | 0 | % 91,753 | 1.559.801,00 | 0,47 |
| 1,0540 % National Grid North Amer. Inc. EO-Med.-Term Nts 2022(22/31) | XS2434710872 | EUR | 1.600 | 1.600 | 0 | % 92,811 | 1.484.976,00 | 0,44 |
| 0,1250 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Medium-Term Nts 2020(27/27) | XS2170362672 | EUR | 2.300 | 0 | 0 | % 95,606 | 2.198.938,00 | 0,66 |
| 1,6250 % NGG Finance PLC EO-FLR Notes 2019(24/79) | XS2010044977 | EUR | 2.000 | 1.200 | 0 | % 97,632 | 1.952.640,00 | 0,58 |
| 2,8750 % OMV AG EO-FLR Notes 2018(24/Und.) | XS1713462403 | EUR | 2.300 | 2.000 | 0 | % 100,500 | 2.311.500,00 | 0,69 |

1) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2022 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|--------------|---|-----------------------|---|-----------------------|-----------|--------------------|------------------------------|
| 1,0000 % OMV AG EO-Medium-Term Notes 2017(26) | XS1734689620 | EUR | 400 | 0 | 0 | % 98,809 | 395.236,00 | 0,12 |
| 2,3750 % Orange S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 19(25/Und.) | FR0013413887 | EUR | 1.700 | 700 | 0 | % 100,958 | 1.716.286,00 | 0,51 |
| 1,3750 % Orange S.A. EO-Med.-Term Notes 2018(18/28) | FR0013323870 | EUR | 2.000 | 0 | 0 | % 100,294 | 2.005.880,00 | 0,60 |
| 1,3750 % Pearson Funding PLC EO-Notes 2015(15/25) | XS1228153661 | EUR | 200 | 0 | 0 | % 98,745 | 197.490,00 | 0,06 |
| 0,6250 % Prologis Euro Finance LLC EO-Notes 2019(19/31) | XS2049583607 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 88,663 | 886.630,00 | 0,27 |
| 4,5000 % Repsol Intl Finance B.V. EO-FLR Securities 2015(25/75) | XS1207058733 | EUR | 2.400 | 0 | 0 | % 104,216 | 2.501.184,00 | 0,75 |
| 1,5000 % RTE Réseau de Transp.d'Electr. EO-Medium-Term Nts 2018(18/30) | FR0013368164 | EUR | 500 | 500 | 0 | % 99,434 | 497.170,00 | 0,15 |
| 0,7500 % SAFRAN EO-Obl. 2021(21/31) | FR0014002G36 | EUR | 1.400 | 0 | 0 | % 89,738 | 1.256.332,00 | 0,38 |
| 1,1250 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB EO-Med.-Term Notes 2019(19/26) | XS2049823680 | EUR | 1.200 | 0 | 0 | % 91,029 | 1.092.348,00 | 0,33 |
| 1,3750 % SAP SE Med.Term Nts. v.2018(29/30) | DE000A2G8VU3 | EUR | 600 | 600 | 0 | % 100,161 | 600.966,00 | 0,18 |
| 0,8750 % SELP Finance S.a.r.l. EO-Notes 2021(21/29) | XS2344569038 | EUR | 3.000 | 0 | 0 | % 89,387 | 2.681.610,00 | 0,80 |
| 1,6250 % SES S.A. EO-Med.-Term Nts 2018(25/26) | XS1796208632 | EUR | 850 | 0 | 0 | % 99,233 | 843.480,50 | 0,25 |
| 0,8750 % SES S.A. EO-Med.-Term Nts 2019(27/27) | XS2075811781 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 93,144 | 931.440,00 | 0,28 |
| 0,2500 % SKF AB EO-Notes 2021(21/31) | XS2297204815 | EUR | 2.500 | 2.500 | 0 | % 86,046 | 2.151.150,00 | 0,64 |
| 2,0000 % Smiths Group PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/27) | XS1570260460 | EUR | 2.000 | 0 | 0 | % 100,902 | 2.018.040,00 | 0,60 |
| 0,0000 % Snam S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2020(28/28) | XS2268340010 | EUR | 800 | 0 | 0 | % 89,132 | 713.056,00 | 0,21 |
| 0,8750 % Snam S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2016(26) | XS1505573482 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 98,016 | 980.160,00 | 0,29 |
| 1,1250 % Société Générale S.A. EO-Non-Preferred MTN 2018(25) | FR0013311503 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 100,480 | 1.004.800,00 | 0,30 |
| 1,3750 % SSE PLC EO-Med.-Term Notes 2018(18/27) | XS1875284702 | EUR | 800 | 0 | 0 | % 99,784 | 798.272,00 | 0,24 |
| 1,7500 % SSE PLC EO-Med.-Term Notes 2020(20/30) | XS2156787173 | EUR | 700 | 700 | 0 | % 99,265 | 694.855,00 | 0,21 |
| 1,5000 % Stedin Holding N.V. EO-FLR Notes 2021(21/Und.) | XS2314246526 | EUR | 800 | 0 | 0 | % 96,471 | 771.768,00 | 0,23 |
| 0,5000 % Stedin Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29) | XS2079678400 | EUR | 400 | 0 | 0 | % 92,908 | 371.632,00 | 0,11 |
| 4,5000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28) | XS2199351375 | EUR | 1.800 | 300 | 0 | % 113,208 | 2.037.744,00 | 0,61 |
| 2,9320 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Notes 2014(29) | XS1120892507 | EUR | 700 | 0 | 0 | % 109,707 | 767.949,00 | 0,23 |
| 2,5000 % Telenor ASA EO-Medium-Term Notes 2013(25) | XS0933241456 | EUR | 600 | 0 | 0 | % 105,443 | 632.658,00 | 0,19 |
| 0,2500 % Telenor ASA EO-Medium-Term Nts 2020(20/28) | XS2117452156 | EUR | 700 | 700 | 0 | % 93,473 | 654.311,00 | 0,20 |
| 1,6250 % Telia Company AB EO-Med.-Term Notes 2015(15/35) | XS1193213953 | EUR | 300 | 0 | 0 | % 95,742 | 287.226,00 | 0,09 |
| 0,1250 % Telia Company AB EO-Med.-Term Notes 2020(20/30) | XS2264161964 | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 | % 87,855 | 878.550,00 | 0,26 |
| 2,3740 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 2020(20/Und.) | XS2207430120 | EUR | 700 | 0 | 0 | % 100,381 | 702.667,00 | 0,21 |
| 0,8750 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2019(19/30) | XS2002491780 | EUR | 500 | 500 | 0 | % 95,263 | 476.315,00 | 0,14 |
| 0,5000 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/40) | XS2262065233 | EUR | 500 | 500 | 0 | % 77,052 | 385.260,00 | 0,12 |
| 1,3750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-Term Notes 2017(27) | XS1652866002 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 99,647 | 996.470,00 | 0,30 |
| 0,8750 % Tesco Corp. Treas. Serv. PLC EO-Medium-Term Notes 19(19/26) | XS2086868010 | EUR | 1.800 | 800 | 0 | % 97,045 | 1.746.810,00 | 0,52 |
| 0,3750 % Tesco Corp. Treas. Serv. PLC EO-Medium-Term Nts 2021(21/29) | XS2289877941 | EUR | 1.000 | 300 | 0 | % 88,167 | 881.670,00 | 0,26 |

8 Metzler Euro Corporates Sustainability Halbjahresbericht

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2022 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|--------------|---|-----------------------|---|-----------------------|-----------|--------------------|------------------------------|
| 1,1250 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2016(16/24) | XS1439749281 | EUR | 1.200 | 0 | 0 | % 94,655 | 1.135.860,00 | 0,34 |
| 1,0230 % TotalEnergies Capital Intl SA EO-Medium-Term Nts 2018(18/27) | XS1874122770 | EUR | 700 | 0 | 0 | % 99,168 | 694.176,00 | 0,21 |
| 2,7080 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 16(23/Und.) | XS1501167164 | EUR | 2.350 | 700 | 0 | % 101,322 | 2.381.067,00 | 0,71 |
| 1,7500 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 19(24/Und.) | XS1974787480 | EUR | 4.000 | 4.000 | 0 | % 99,808 | 3.992.320,00 | 1,19 |
| 2,1250 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 21(21/Und.) | XS2290960876 | EUR | 800 | 800 | 0 | % 86,091 | 688.728,00 | 0,21 |
| 3,2500 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 22(22/Und.) | XS2432131188 | EUR | 1.300 | 1.300 | 0 | % 90,261 | 1.173.393,00 | 0,35 |
| 0,1250 % Toyota Motor Credit Corp. EO-Medium-Term Notes 2021(27) | XS2338955805 | EUR | 1.300 | 0 | 0 | % 93,150 | 1.210.950,00 | 0,36 |
| 1,4500 % Transurban Finance Co. Pty Ltd EO-Medium-Term Nts 2019(19/29) | XS1997077364 | EUR | 800 | 0 | 0 | % 96,791 | 774.328,00 | 0,23 |
| 0,1250 % TRATON Finance Luxembourg S.A. EO-Med.-Term Nts 2021(24/24) | DE000A3KYMA6 | EUR | 2.800 | 3.800 | 1.000 | % 97,173 | 2.720.844,00 | 0,81 |
| 1,2500 % TRATON Finance Luxembourg S.A. EO-Med.-Term Nts 2021(32/33) | DE000A3KNQA0 | EUR | 1.500 | 1.500 | 0 | % 87,449 | 1.311.735,00 | 0,39 |
| 0,6250 % UBS Group AG EO-Non-Preferred MTN 2021(33) | CH0595205532 | EUR | 800 | 0 | 0 | % 88,446 | 707.568,00 | 0,21 |
| 2,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-FLR Bonds 2018(23/Und.) ¹⁾ | FR0013330529 | EUR | 1.500 | 0 | 0 | % 98,330 | 1.474.950,00 | 0,44 |
| 4,8750 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Med.-T. Nts 19(24/29) | XS1953271225 | EUR | 600 | 0 | 0 | % 103,791 | 622.746,00 | 0,19 |
| 1,2500 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Preferred MTN 20(25/26) | XS2190134184 | EUR | 1.500 | 0 | 0 | % 98,283 | 1.474.245,00 | 0,44 |
| 0,8500 % UniCredit S.p.A. EO-Preferred MTN 2021(31) | XS2289133758 | EUR | 1.500 | 500 | 0 | % 86,809 | 1.302.135,00 | 0,39 |
| 1,0000 % Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Notes 2017(27) | XS1566101603 | EUR | 800 | 0 | 0 | % 99,804 | 798.432,00 | 0,24 |
| 0,2500 % V.F. Corp. EO-Notes 2020(20/28) | XS2123970167 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 92,722 | 927.220,00 | 0,28 |
| 2,2500 % Veolia Environnement S.A. EO-FLR Notes 2020(26/Und.) | FR00140007K5 | EUR | 1.400 | 0 | 0 | % 97,524 | 1.365.336,00 | 0,41 |
| 1,3750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2017(17/26) | XS1708161291 | EUR | 1.150 | 0 | 0 | % 100,931 | 1.160.706,50 | 0,35 |
| 0,8750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2019(19/32) | XS2052320954 | EUR | 1.500 | 0 | 0 | % 92,176 | 1.382.640,00 | 0,41 |
| 0,7500 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2021(21/32) Reg.S | XS2320759884 | EUR | 1.100 | 0 | 0 | % 91,323 | 1.004.553,00 | 0,30 |
| 2,0000 % Vesteda Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2018(18/26) | XS1854166078 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 102,254 | 1.022.540,00 | 0,31 |
| 0,1250 % Vier Gas Transport GmbH Med.Term.Notes v.2019(19/29) | XS2049090595 | EUR | 1.300 | 600 | 0 | % 88,132 | 1.145.716,00 | 0,34 |
| 1,1250 % Vodafone Group PLC EO-Medium-Term Notes 2017(25) | XS1721423462 | EUR | 2.850 | 0 | 0 | % 100,428 | 2.862.198,00 | 0,86 |
| 3,3750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2018(24/Und.) | XS1799938995 | EUR | 3.500 | 2.000 | 0 | % 101,573 | 3.555.055,00 | 1,06 |
| 3,7480 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2022(27/Und.) | XS2342732562 | EUR | 1.300 | 1.300 | 0 | % 99,750 | 1.296.750,00 | 0,39 |
| 4,1250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Notes 2018(38) | XS1910948675 | EUR | 1.300 | 500 | 0 | % 120,090 | 1.561.170,00 | 0,47 |
| 0,0000 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.21(21/24) | XS2343821794 | EUR | 3.100 | 0 | 0 | % 97,500 | 3.022.500,00 | 0,90 |
| 0,6250 % Volvo Treasury AB EO-Med.-Term Nts 2022(22/25) | XS2440678915 | EUR | 1.500 | 1.500 | 0 | % 98,852 | 1.482.780,00 | 0,44 |
| 1,1250 % Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2019(34/34) | DE000A2R7JE1 | EUR | 1.300 | 0 | 0 | % 84,837 | 1.102.881,00 | 0,33 |
| 0,0000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/25) | DE000A3MP4T1 | EUR | 1.400 | 0 | 0 | % 94,714 | 1.325.996,00 | 0,40 |
| 1,6250 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/51) | DE000A3MP4W5 | EUR | 600 | 0 | 0 | % 77,908 | 467.448,00 | 0,14 |

1) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2022 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|---------------|---|-----------------------|---|-----------------------|------------|----------------------|------------------------------|
| 1,3750 % Vonovia SE Medium Term Notes v.22(22/26) | DE000A3MQS56 | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 | % 99,398 | 993.980,00 | 0,30 |
| 1,3750 % Wendel SE EO-Obl. 2022(22/34) | FR0014006VH2 | EUR | 1.500 | 1.500 | 0 | % 90,664 | 1.359.960,00 | 0,41 |
| 0,9540 % Wesfarmers Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(21/33) | XS2399154181 | EUR | 2.400 | 2.400 | 0 | % 88,977 | 2.135.448,00 | 0,64 |
| 1,5000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 2017(17/27) | XS1575992596 | EUR | 900 | 0 | 0 | % 100,679 | 906.111,00 | 0,27 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | | | EUR | 63.900.024,50 | 19,12 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | EUR | 63.900.024,50 | 19,12 |
| 2,6250 % Allianz SE FLR-Sub.Ter.Nts.v.20(30/unb.) | DE000A289FK7 | EUR | 6.000 | 3.600 | 0 | % 91,358 | 5.481.480,00 | 1,64 |
| 1,8750 % American Medical Syst.Eu. B.V. EO-Notes 2022(22/34) | XS2452435295 | EUR | 500 | 500 | 0 | % 97,518 | 487.590,00 | 0,15 |
| 1,5000 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd. EO-Med.-Term Nts 2015(15/27) | XS11191877452 | EUR | 650 | 0 | 0 | % 99,141 | 644.416,50 | 0,19 |
| 0,6250 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd. EO-Med.-Term Nts 2020(20/30) | XS2118213888 | EUR | 1.200 | 700 | 0 | % 89,349 | 1.072.188,00 | 0,32 |
| 6,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Notes 2020(26/Und.) | ES0813211028 | EUR | 1.600 | 1.600 | 0 | % 104,655 | 1.674.480,00 | 0,50 |
| 1,3360 % Becton Dickinson Euro Fin.Sarl EO-Notes 2021(21/41) | XS2375844656 | EUR | 400 | 0 | 0 | % 82,222 | 328.888,00 | 0,10 |
| 5,8750 % Caixaabank S.A. EO-FLR Notes 2020(27/Und.) | ES0840609020 | EUR | 1.200 | 1.200 | 0 | % 105,678 | 1.268.136,00 | 0,38 |
| 0,6500 % Credit Suisse Group AG EO-Medium-Term Nts 2019(19/29) | CH0494734418 | EUR | 1.100 | 0 | 0 | % 88,265 | 970.915,00 | 0,29 |
| 1,0000 % Czech Gas Netw.Invest.S.à r.l. EO-Notes 2020(20/27) | XS2193733503 | EUR | 400 | 0 | 0 | % 95,062 | 380.248,00 | 0,11 |
| 0,8750 % Czech Gas Netw.Invest.S.à r.l. EO-Notes 2021(21/31) | XS2322438990 | EUR | 1.300 | 0 | 0 | % 85,718 | 1.114.334,00 | 0,33 |
| 2,2500 % DIC Asset AG Anleihe v.2021(2021/2026) | XS2388910270 | EUR | 1.500 | 0 | 0 | % 88,098 | 1.321.470,00 | 0,40 |
| 3,7500 % ELM B.V. EO-FLR M.-T. Nts 2020(25/Und.) | XS2182055009 | EUR | 3.700 | 1.900 | 0 | % 101,206 | 3.744.622,00 | 1,12 |
| 1,6250 % Engie S.A. EO-FLR Notes 2019(25/Und.) | FR0013431244 | EUR | 1.000 | 1.000 | 0 | % 96,930 | 969.300,00 | 0,29 |
| 1,6980 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2019(19/26) | XS2034622048 | EUR | 900 | 0 | 0 | % 83,500 | 751.500,00 | 0,22 |
| 3,1250 % Faurecia SE EO-Notes 2019(19/26) | XS1963830002 | EUR | 1.800 | 0 | 0 | % 95,713 | 1.722.834,00 | 0,52 |
| 2,3750 % Faurecia SE EO-Notes 2019(19/27) | XS2081474046 | EUR | 2.000 | 1.000 | 0 | % 89,536 | 1.790.720,00 | 0,54 |
| 1,2500 % GSK Consumer Health.Cap.NL BV EO-Med.-Term Notes 2022(22/26) | XS2462324745 | EUR | 1.400 | 1.400 | 0 | % 100,067 | 1.400.938,00 | 0,42 |
| 3,2480 % Heimstaden Bostad AB EO-FLR Cap. 2019(25/Und.) | XS2010037765 | EUR | 1.700 | 300 | 0 | % 94,867 | 1.612.739,00 | 0,48 |
| 3,0000 % Heimstaden Bostad AB EO-FLR Notes 2021(21/Und.) | XS2357357768 | EUR | 1.800 | 200 | 0 | % 84,124 | 1.514.232,00 | 0,45 |
| 1,8740 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Notes 2020(20/Und.) | XS2244941063 | EUR | 1.300 | 0 | 0 | % 96,887 | 1.259.531,00 | 0,38 |
| 0,0000 % JDE Peet's N.V. EO-Med.-Term Notes 2021(21/26) | XS2354444023 | EUR | 2.000 | 0 | 0 | % 94,311 | 1.886.220,00 | 0,56 |
| 0,6250 % Kerry Group Financial Services EO-Notes 2019(19/29) | XS2042667944 | EUR | 1.400 | 0 | 0 | % 91,707 | 1.283.898,00 | 0,38 |
| 1,8750 % Mandatum Life Insurance Co.Ltd EO-FLR Notes 2019(24/49) | XS2053053273 | EUR | 5.000 | 1.900 | 0 | % 98,484 | 4.924.200,00 | 1,47 |
| 0,6250 % Mölnlycke Holding AB EO-Medium-Term Nts 2020(20/31) | XS2270406452 | EUR | 2.800 | 2.800 | 0 | % 86,035 | 2.408.980,00 | 0,72 |
| 0,8750 % Mondelez Intl Hldgs Nether. BV EO-Notes 2019(19/31) Reg.S | XS2056374353 | EUR | 1.700 | 0 | 0 | % 93,341 | 1.586.797,00 | 0,47 |
| 3,1250 % Mylan II B.V. EO-Notes 2016(16/28) | XS1492458044 | EUR | 2.000 | 0 | 0 | % 102,659 | 2.053.180,00 | 0,61 |
| 1,6250 % ProLogis Intl Funding II S.A. EO-Med.-Term Nts 2020(20/32) | XS2187529180 | EUR | 800 | 800 | 0 | % 94,355 | 754.840,00 | 0,23 |
| 0,9500 % Rentokil Initial PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/24) | XS1722897623 | EUR | 800 | 0 | 0 | % 99,650 | 797.200,00 | 0,24 |
| 0,8750 % Rentokil Initial PLC EO-Med.-Term Notes 2019(19/26) | XS1996441066 | EUR | 1.400 | 1.000 | 0 | % 96,803 | 1.355.242,00 | 0,41 |

10 Metzler Euro Corporates Sustainability Halbjahresbericht

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022

| Gattungsbezeichnung | ISIN | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2022 | Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe / Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|--------------|---|-----------------------|---|-----------------------|------------|-----------------------|------------------------------|
| 0,5000 % Rentokil Initial PLC EO-Med.-Term Notes 2020(20/28) | XS2242921711 | EUR | 2.100 | 0 | 0 | % 90,524 | 1.901.004,00 | 0,57 |
| 2,6250 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB EO-FLR Cap. 2020(25/Und.) | XS2272358024 | EUR | 1.300 | 0 | 0 | % 84,696 | 1.101.048,00 | 0,33 |
| 2,6250 % Sigma Alimentos S.A. EO-Notes 2017(17/24) Reg.S | XS1562623584 | EUR | 2.100 | 2.100 | 0 | % 101,986 | 2.141.706,00 | 0,64 |
| 2,7500 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2022(22/32) | XS2464732770 | EUR | 1.400 | 1.400 | 0 | % 100,675 | 1.409.450,00 | 0,42 |
| 1,3750 % Telia Company AB EO-FLR Securities 2020(26/81) | XS2082429890 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 96,658 | 966.580,00 | 0,29 |
| 1,3750 % Telstra Corp. Ltd. EO-Med.-Term Notes 2019(19/29) | XS1966038249 | EUR | 700 | 700 | 0 | % 99,704 | 697.928,00 | 0,21 |
| 3,2500 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2018(18/22) | XS1812903828 | EUR | 500 | 0 | 0 | % 100,089 | 500.445,00 | 0,15 |
| 2,0000 % Thermo Fisher Scient.(Fin.I)BV EO-Notes 2021(21/51) | XS2366415540 | EUR | 2.500 | 2.500 | 0 | % 90,982 | 2.274.550,00 | 0,68 |
| 3,0000 % Transurban Finance Co. Pty Ltd EO-Medium-Term Nts 2020(20/30) | XS2152883406 | EUR | 800 | 0 | 0 | % 107,225 | 857.800,00 | 0,26 |
| 1,9080 % Upjohn Finance B.V. EO-Notes 2020(20/32) | XS2193983108 | EUR | 900 | 0 | 0 | % 90,155 | 811.395,00 | 0,24 |
| 2,4985 % Wintershall Dea Finance 2 B.V. EO-FLR Bonds 2021(21/Und.) | XS2286041517 | EUR | 2.000 | 0 | 0 | % 87,963 | 1.759.260,00 | 0,53 |
| 0,8400 % Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/25) | XS2054209833 | EUR | 1.500 | 0 | 0 | % 93,989 | 1.409.835,00 | 0,42 |
| 1,3750 % WPP Finance 2016 EO-Med.-T.Nts 2018(18/25) | XS1794084068 | EUR | 1.500 | 0 | 0 | % 100,527 | 1.507.905,00 | 0,45 |
| Investmentanteile | | | | | | EUR | 2.857.200,00 | 0,85 |
| Gruppenfremde Investmentanteile | | | | | | EUR | 2.857.200,00 | 0,85 |
| Mll.-Metz.EO Cor.Sh.Term Sust. Reg. Shs Class X EUR Dis. oN | IE00BGJWXS78 | ANT | 30.000 | 0 | 0 | EUR 95,240 | 2.857.200,00 | 0,85 |
| Summe Wertpapiervermögen²⁾ | | | | | | EUR | 328.175.441,00 | 98,20 |

2) Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Vermögensaufstellung zum 31. März 2022

| Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 31.03.2022 | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|---|-------|---|--|------------|--|---------------------------------|
| Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.) | | | | EUR | -312.762,23 | -0,09 |
| Zins-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | EUR | 164.970,00 | 0,05 |
| Zinsterminkontrakte | | | | EUR | 164.970,00 | 0,05 |
| FUTURE EURO-BOBL 06.22 EUREX | 185 | EUR | -3.000.000 | | 130.200,00 | 0,04 |
| FUTURE EURO-BUND 06.22 EUREX | 185 | EUR | 900.000 | | -630,00 | 0,00 |
| FUTURE EURO-BUXL 06.22 EUREX | 185 | EUR | 700.000 | | -120.120,00 | -0,04 |
| FUTURE LONG TERM EURO BTP 06.22 EUREX | 185 | EUR | -1.200.000 | | 70.950,00 | 0,02 |
| FUTURE LONG TERM EURO OAT 06.22 EUREX | 185 | EUR | -2.100.000 | | 84.570,00 | 0,03 |
| Swaps Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | EUR | -477.732,23 | -0,14 |
| Credit Default Swaps | | | | EUR | -477.732,23 | -0,14 |
| Protection Buyer iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 20.12.2021/20.12.2026 | OTC | EUR | 30.000.000 | | -477.732,23 | -0,14 |
| Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | EUR | 3.276.850,50 | 0,98 |
| Bankguthaben EUR-Guthaben bei: B. Metzler seel Sohn & Co. AG | | EUR | 3.276.850,50 | % 100,000 | 3.276.850,50 | 0,98 |
| Sonstige Vermögensgegenstände Zinsansprüche Einschüsse (Initial Margins) | | EUR | 2.513.172,96 678.845,00 | | 2.513.172,96 678.845,00 | 0,75 0,20 |
| Sonstige Verbindlichkeiten Zinsverbindlichkeiten Verwaltungsvergütung Verwahrstellenvergütung Lagerstellenkosten | | EUR | -10.792,20 -85.324,46 -14.220,72 -17.752,50 | | -10.792,20 -85.324,46 -14.220,72 -17.752,50 | -0,00 -0,03 0,00 -0,01 |
| Fondsvermögen | | | | EUR | 334.203.457,35 | 100,00³⁾ |
| Metzler Euro Corporates Sustainability AI | | | | EUR | 123,91 | |
| Anteilwert | | | | EUR | 123,91 | |
| Ausgabepreis | | | | EUR | 123,91 | |
| Rücknahmepreis | | | | STK | 2.697.082 | |

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

Erläuterungen zu den Wertpapier-Darlehen

| Identifikation | Gattungsbezeichnung | | Nominal in Stk. bzw. Whg. in 1.000 | Wertpapier-Darlehen Kurswert in EUR | | gesamt |
|--|---|-----|--|--|--------------|--------------|
| | | | | befristet | unbefristet | |
| Folgende Wertpapiere sind zum Berichtsstichtag als Wertpapier-Darlehen übertragen: | | | | | | |
| DE000A3E5VK1 | LEG Immobilien SE Medium Term Notes v.21(21/31) | EUR | 1.000,00 | 0,00 | 875.480,00 | |
| FR0013330529 | Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-FLR Bonds 2018(23/Und.) | EUR | 1.500,00 | 0,00 | 1.474.950,00 | |
| Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen | | | EUR | | 0,00 | 2.350.430,00 |

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Marktschlüssel

b) Terminbörsen

185

Eurex Deutschland

c) OTC

Over-the-Counter

**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 |
|---|--------------|-------------------------------------|-----------------------|--------------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| 1,3750 % American Tower Corp. EO-Notes 2017(17/25) | XS1591781452 | EUR | 0 | 1.100 |
| 1,1250 % Argentum Netherlands B.V. EO-M-T.LPN 18(25/25)A Givaudan | XS1875331636 | EUR | 0 | 400 |
| 1,5000 % Aaroundtown SA EO-Anleihe 2019(26/26) | XS1843435501 | EUR | 0 | 1.000 |
| 2,9500 % Autoroutes du Sud de la France EO-Med.-Term Notes 2014(14/24) | FR0011694033 | EUR | 0 | 500 |
| 1,2500 % Autoroutes du Sud de la France EO-Med.-Term Notes 2017(17/27) | FR0013231099 | EUR | 0 | 400 |
| 0,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2020(25) | XS2182404298 | EUR | 0 | 500 |
| 2,3750 % Bank of America Corp. EO-Medium-Term Notes 2014(24) | XS1079726334 | EUR | 0 | 500 |
| 1,1250 % Bertelsmann SE & Co. KGaA MTN-Anleihe v.2016(2026/2026) | XS1400165350 | EUR | 0 | 1.500 |
| 0,5000 % Caixabank S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(28/29) | XS2297549391 | EUR | 0 | 1.600 |
| 1,7500 % Carrefour S.A. EO-Med.-Term Notes 2018(18/26) | FR0013383213 | EUR | 0 | 1.000 |
| 1,2500 % CK Hutchison Eur.Fin.(18) Ltd. EO-Notes 2018(25) | XS1806124753 | EUR | 0 | 1.500 |
| 0,8750 % CK Hutchison Fin. (16) II Ltd. EO-Notes 2016(24) | XS1497312295 | EUR | 0 | 1.500 |
| 1,0000 % Covivio Hotels S.C.A. EO-Obl. 2021(21/29) | FR0014004QI5 | EUR | 1.300 | 1.300 |
| 4,7500 % Crédit Agricole Assurances SA EO-FLR Notes 2016(28/48) | FR0013203734 | EUR | 0 | 800 |
| 2,7500 % Deutsche Post AG Medium Term Notes v.13(23) | XS0977496636 | EUR | 0 | 400 |
| 0,6250 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 2016(23) | XS1382792197 | EUR | 0 | 550 |
| 0,4500 % DH Europe Finance II S.à r.L. EO-Notes 2019(19/28) | XS2050404800 | EUR | 0 | 1.500 |
| 1,3500 % DH Europe Finance II S.à r.L. EO-Notes 2019(19/39) | XS2050406177 | EUR | 0 | 1.200 |
| 1,5000 % E.ON Intl Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2018(29/29) | XS1761785077 | EUR | 0 | 700 |
| 0,2500 % E.ON SE Medium Term Notes v.19(26/26) | XS2069380991 | EUR | 0 | 600 |
| 2,0000 % EDP Finance B.V. EO-Medium-Term Notes 2015(25) | XS1222590488 | EUR | 0 | 500 |
| 1,5000 % ENI S.p.A. EO-Medium-Term Notes 2015(26) | XS1180451657 | EUR | 0 | 600 |
| 0,7500 % Equinor ASA EO-Medium-Term Nts 2020(20/26) | XS2178833427 | EUR | 0 | 500 |
| 1,6250 % Givaudan Finance Europe B.V. EO-Notes 2020(20/32) | XS2126170161 | EUR | 0 | 800 |
| 5,0000 % Hannover Finance (Lux.) S.A. EO-FLR Notes 2012(23/43) | XS0856556807 | EUR | 1.000 | 1.000 |
| 0,6250 % Heimstaden Bostad Treasury B.V EO-Medium-Term Nts 2022(22/25) | XS2435603571 | EUR | 2.000 | 2.000 |
| 1,2500 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 2017(17/27) | XS1682538183 | EUR | 0 | 1.500 |
| 1,1250 % Iberdrola International B.V. EO-Medium-Term Notes 2016(26) | XS1398476793 | EUR | 0 | 500 |
| 0,1000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2019(24/25) | XS2049154078 | EUR | 0 | 1.100 |
| 1,0000 % ING Groep N.V. EO-Med.-Term Notes 2018(23) | XS1882544627 | EUR | 0 | 1.200 |
| 1,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2019(24) | XS2022425297 | EUR | 0 | 1.700 |
| 0,7500 % Kering S.A. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28) | FR0013512407 | EUR | 0 | 200 |
| 0,8750 % LEG Immobilien SE Medium Term Notes v.19(19/27) | DE000A254P51 | EUR | 0 | 900 |
| 0,6250 % Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2018(23/24) | XS1749378342 | EUR | 0 | 1.000 |
| 0,1250 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/28) | FR0013482833 | EUR | 0 | 1.500 |
| 3,2500 % Münchener Rückvers.-Ges. AG FLR-Nachr.-Anl. v.18(29/49) | XS1843448314 | EUR | 0 | 1.500 |
| 0,2500 % National Australia Bank Ltd. EO-Medium-Term Nts 2019(24) | XS1998797663 | EUR | 0 | 2.600 |
| 0,0000 % OMV AG EO-Medium-Term Notes 2019(25) | XS2022093434 | EUR | 0 | 700 |
| 1,1250 % Orange S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(19/24) | FR0013396512 | EUR | 0 | 700 |
| 1,0000 % Raiffeisen Bank Intl AG EO-Pref. Med.-T. Nts 18(23)166 | XS1917591411 | EUR | 0 | 600 |
| 2,2500 % Talanx AG FLR-Nachr.-Anl. v.17(27/47) | XS1729882024 | EUR | 0 | 1.200 |
| 1,7880 % Telefonica Emisiones S.A.U. EO-Medium-Term Nts 2019(19/29) | XS1961772560 | EUR | 0 | 800 |
| 3,0000 % Telia Company AB EO-Medium-Term Notes 2012(27) | XS0826189028 | EUR | 0 | 400 |
| 0,5000 % Toyota Finance Australia Ltd. EO-Medium-Term Notes 2018(23) | XS1801780583 | EUR | 0 | 550 |
| 2,0040 % Toyota Finance Australia Ltd. EO-Medium-Term Notes 2020(24) | XS2156236296 | EUR | 0 | 1.200 |
| 0,0500 % Vattenfall AB EO-Medium-Term Notes 20(20/25) | XS2133390521 | EUR | 0 | 400 |
| 0,6250 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/29) | DE000A3E5MH6 | EUR | 0 | 1.000 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| 2,2500 % ADLER Group S.A. EO-Medium-T. Notes 2021(21/27) | XS2336188029 | EUR | 0 | 500 |
| 1,1250 % Coca-Cola Europacific Pa. PLC EO-Notes 2016(16/24) | XS1415535340 | EUR | 0 | 2.200 |
| 1,8750 % Mölnlycke Holding AB EO-Notes 2017(25) | XS1564337993 | EUR | 300 | 1.400 |
| 0,2500 % PepsiCo Inc. EO-Notes 2020(20/24) | XS2168625460 | EUR | 1.300 | 2.000 |
| 1,6250 % Thermo Fisher Scient.(Fin.)BV EO-Notes 2021(21/41) | XS2366415201 | EUR | 2.800 | 2.800 |
| 3,0000 % WPP Finance 2013 EO-Medium Term Nts 2013(13/23) | XS0995643003 | EUR | 0 | 1.000 |

**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 |
|--|--------------|-------------------------------------|-----------------------|--------------------------|
| Neuemissionen | | | | |
| Zulassung zum Börsenhandel vorgesehen | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| 1,0000 % Covivio Hotels S.C.A. EO-Obl. 2021(21/29) Tr.2 | FR0014006C10 | EUR | 1.300 | 1.300 |
| Nichtnotierte Wertpapiere ¹⁾ | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| 1,1500 % Dongfeng Motor(HK)Intl Co.Ltd. EO-Bonds 2018(18/21) | XS1886120168 | EUR | 0 | 500 |
| 5,2500 % OMV AG EO-FLR Notes 2015(21/Und.) | XS1294342792 | EUR | 0 | 800 |
| 4,0000 % Vonovia Finance B.V. EO-FLR Notes 2014(21/Und.) | XS1117300837 | EUR | 0 | 2.000 |

| Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000 | Volumen in 1.000 |
|---|-------------------------------------|---------------------|
| Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe) | | |
| Terminkontrakte | | |
| Zinsterminkontrakte | | |
| Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): 8,5-10,5Y.FR.GO.GB.SYN.AN, 8,5-10Y.ITA.GOV.BD.SYN.AN, EURO-BUND, EURO-BUXL, EURO-SCHATZ) | EUR | 307.494,63 |
| Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): 8,5-10,5Y.FR.GO.GB.SYN.AN, 8,5-10Y.ITA.GOV.BD.SYN.AN, EURO-BOBL, EURO-BUND, EURO-BUXL, EURO-SCHATZ) | EUR | 408.332,50 |
| Swaps (in Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen) | | |
| Credit Default Swaps | | |
| Protection Buyer (Basiswert(e): iTraxx Europe Series 36 Index (5 Year) 20.09.2021/20.12.2026) | EUR | 30.000 |

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

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

| | |
|--|--------------|
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) | 98,20 |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) | -0,09 |

Sonstige Angaben

Metzler Euro Corporates Sustainability AI

| | | |
|----------------|-----|-----------|
| Anteilwert | EUR | 123,91 |
| Ausgabepreis | EUR | 123,91 |
| Rücknahmepreis | EUR | 123,91 |
| Anzahl Anteile | STK | 2.697.082 |

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.

Infolge des Krieges zwischen Russland und der Ukraine und der damit verbundenen Sanktionen kann es zu massiven Verwerfungen an allen Kapitalmärkten und somit zu besonderen Bewertungsunsicherheiten kommen.

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.

Zusätzliche Anhangsangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Wertpapierleihe

Für Wertpapierleihegeschäfte verwendete Vermögensgegenstände zum Stichtag

| | | |
|-------------------------|-----|--------------|
| absolut | EUR | 2.350.430,00 |
| in % des Fondsvermögens | | 0,70 |

Größte Gegenpartei(en) von Wertpapierleihegeschäften

| Rang | Name | Bruttovolumen der offenen Geschäfte in EUR | Sitzstaat |
|------|---------------------------------------|--|------------------------|
| 1 | B. Metzler seel Sohn & Co. AG (G) (V) | 2.350.430,00 | Bundesrep. Deutschland |

Art(en) von Abwicklung und Clearing bei Wertpapierleihegeschäften

Die Darlehensverträge werden unter Einbeziehung eines Agents als Vermittler, der für Rechnung des Fonds handelt, abgeschlossen.

Wertpapierleihegeschäfte gegliedert nach Restlaufzeit

| Laufzeitband | Bruttovolumen in EUR |
|---------------------------|----------------------|
| < 1 Tag | 0,00 |
| >= 1 Tag bis < 1 Woche | 0,00 |
| >= 1 Woche bis < 1 Monat | 0,00 |
| >= 1 Monat bis < 3 Monate | 0,00 |
| >= 3 Monate bis < 1 Jahr | 0,00 |
| >= 1 Jahr | 0,00 |
| unbefristet | 2.350.430,00 |

Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte

Sicherheiten in Geld oder in Wertpapieren auf Basis des zum jeweiligen Marktpreis errechneten Gegenwertes der Darlehenspapiere in Geld, ggf. zuzüglich der angefallenen Stückzinsen müssen von den Gegenparteien gestellt werden. Der Agent überwacht laufend, dass der Wert der erhaltenen Sicherheiten den errechneten Gegenwert der Darlehenspapiere in Geld zuzüglich eines marktüblichen Aufschlages zu keinem Zeitpunkt unterschreitet.

Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte

Zum Stichtag hat der Fonds Sicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte in den folgenden Währungen erhalten: EUR

Sicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten

| Laufzeitband | Marktwert der Sicherheiten in EUR |
|---------------------------|-----------------------------------|
| < 1 Tag | 0,00 |
| >= 1 Tag bis < 1 Woche | 0,00 |
| >= 1 Woche bis < 1 Monat | 0,00 |
| >= 1 Monat bis < 3 Monate | 0,00 |
| >= 3 Monate bis < 1 Jahr | 0,00 |
| >= 1 Jahr | 0,00 |
| unbefristet | 2.611.076,00 |

Größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf die erhaltenen Wertpapiersicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte

| Rang | Name | Volumen empfangene Sicherheiten in EUR |
|------|----------------------------|--|
| 1 | Deutsche Pfandbriefbank AG | 2.611.076,00 |

Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierleihegeschäften

| | |
|--|---------------------------|
| Gesamtzahl der Verwahrer / Kontoführer | 1 |
| Name | verwahrter Betrag absolut |
| B. Metzler seel Sohn & Co. AG (G) (V) | 2.611.076,00 |

Zusätzliche Anhangsangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Ertrags- und Kostenanteile für Wertpapierleihegeschäfte

Erträge in der Berichtsperiode

| Empfänger | Absoluter Betrag in EUR | in % der Bruttoerträge |
|--------------------------------|-------------------------|------------------------|
| Anteilklasse | 223,38 | 50,00% |
| Kapitalverwaltungsgesellschaft | 44,68 | 10,00% |
| Dritter | 178,70 | 40,00% |

Kosten in der Berichtsperiode

Im Zusammenhang mit Wertpapierleihegeschäften sind auf Fondsebene im Laufe der Berichtsperiode Kosten entstanden in Höhe von EUR: 0,00

Verliehene Wertpapiere in Prozent aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds zum Stichtag¹⁾

Anteil der verliehenen Wertpapiere 0,72%

Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten

Die durch den Fonds erhaltenen Barsicherheiten werden nicht wiederangelegt.

Die durch den Fonds erhaltenen Wertpapiersicherheiten werden nicht weiterverwendet.

* Die hier angegebene Prozentzahl bezieht sich auf das gesamte Wertpapiervermögen des Fonds. Die Anlagebedingungen können jedoch Beschränkungen enthalten, sodass das Verleihen ggf. nur in geringerem Umfang zulässig ist.

Frankfurt am Main, den 27. April 2022

Metzler Asset Management GmbH
Die Geschäftsführung

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. Zudem wurden redaktionelle Änderungen der Besonderen Anlagebedingungen vorgenommen.

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