

Unabhängig seit 1674

**METZLER**

*Asset Management*

# Halbjahresbericht

zum 31. März 2024

**Metzler Asset Management GmbH**

Metzler Euro Corporates Sustainability

**ungeprüft**

Inhaltsverzeichnis	1
--------------------	---

---

<b>Halbjahresbericht</b> .....	2
--------------------------------	---

<b>OGAW-Sondervermögen</b>	
Metzler Euro Corporates Sustainability .....	2

<b>Weitere Informationen</b> .....	18
------------------------------------	----

## 2 Metzler Euro Corporates Sustainability Halbjahresbericht

### Vermögensübersicht zum 31. März 2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>330.107.477,92</b>	<b>100,04</b>
1. Anleihen	323.358.769,50	97,99
< 1 Jahr	22.104.701,00	6,70
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	52.185.901,00	15,81
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	52.202.051,00	15,82
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	150.300.900,50	45,55
>= 10 Jahre	46.565.216,00	14,11
2. Derivate	-24.980,00	-0,01
3. Bankguthaben	2.388.648,29	0,72
4. Sonstige Vermögensgegenstände	4.385.040,13	1,33
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-128.606,11</b>	<b>-0,04</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>329.978.871,81</b>	<b>100,00</b>

**Vermögensaufstellung zum 31. März 2024**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>Bestandspositionen</b>						<b>EUR</b>	<b>323.358.769,50</b>	<b>97,99</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>						<b>EUR</b>	<b>261.930.327,50</b>	<b>79,38</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>						<b>EUR</b>	<b>261.930.327,50</b>	<b>79,38</b>
0,5000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Med.-T. Nts 2021(29)	XS2389343380	EUR	400	0	0	% 85,673	342.692,00	0,10
1,1250 % Aéroports de Paris S.A. EO-Obl. 2019(19/34)	FR0013426368	EUR	1.100	0	0	% 80,625	886.875,00	0,27
5,7500 % AIB Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(28/29)	XS2555925218	EUR	1.600	0	0	% 107,196	1.715.136,00	0,52
2,2500 % AIB Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2022(26/28)	XS2464405229	EUR	2.000	0	0	% 95,896	1.917.920,00	0,58
5,2500 % AIB Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2023(30/31)	XS2707169111	EUR	3.000	3.000	0	% 108,060	3.241.800,00	0,98
0,5000 % alstria office REIT-AG Anleihe v.2019(2019/2025)	XS2053346297	EUR	1.000	0	0	% 90,497	904.970,00	0,27
4,7500 % Anglo American Capital PLC EO-Medium-Term Notes 22(32/32)	XS2536431617	EUR	1.300	0	0	% 105,077	1.366.001,00	0,41
3,4500 % Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/31)	BE6350702153	EUR	700	700	0	% 101,399	709.793,00	0,22
7,1250 % APA Infrastructure Ltd. EO-FLR Bonds 2023(29/83)	XS2711801287	EUR	3.000	3.000	0	% 107,315	3.219.450,00	0,98
1,5000 % APRR EO-Medium-Term Nts 2017(17/33)	FR0013295722	EUR	700	0	0	% 86,350	604.450,00	0,18
1,8750 % APRR EO-Medium-Term Nts 2022(22/29)	FR001400AOL7	EUR	800	0	0	% 94,516	756.128,00	0,23
3,3750 % Arountown SA EO-FLR Notes 2019(24/Und.)	XS2055106210	EUR	1.000	0	0	% 59,512	595.120,00	0,18
0,3750 % Arountown SA EO-Med.-Term Notes 2021(21/27)	XS2421195848	EUR	1.000	0	0	% 83,972	839.720,00	0,25
0,3360 % Asahi Group Holdings Ltd. EO-Notes 2021(21/27)	XS2328981431	EUR	1.000	0	0	% 91,053	910.530,00	0,28
3,7500 % Assa-Abloy AB EO-Medium-Term Nts 2023(23/26)	XS2678207676	EUR	1.200	0	0	% 100,989	1.211.868,00	0,37
4,1250 % Assa-Abloy AB EO-Medium-Term Nts 2023(23/35)	XS2678191904	EUR	600	0	0	% 106,593	639.558,00	0,19
1,8000 % AT & T Inc. EO-Notes 2018(19/26)	XS1907120528	EUR	2.500	0	0	% 96,441	2.411.025,00	0,73
3,1250 % Aurizon Network Pty Ltd. EO-Med.-Term Nts 2016(16/26)	XS1418788599	EUR	1.150	0	0	% 98,727	1.135.360,50	0,34
0,8750 % Ausgrid Finance Pty Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(21/31)	XS2391430837	EUR	1.200	0	0	% 81,902	982.824,00	0,30
2,7500 % Autoroutes du Sud de la France EO-Medium-Term Nts 2022(22/32)	FR001400CH94	EUR	2.000	0	0	% 96,344	1.926.880,00	0,58
1,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Med.-T.Nts 2020(25/30)	XS2104051433	EUR	1.500	0	0	% 97,208	1.458.120,00	0,44
5,7500 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Med.-T.Nts 2023(28/33)	XS2636592102	EUR	3.000	0	0	% 105,385	3.161.550,00	0,96
3,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2022(27)	XS2534785865	EUR	1.300	0	0	% 100,037	1.300.481,00	0,39
3,8750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 2024(34)	XS2747065030	EUR	1.700	1.700	0	% 101,902	1.732.334,00	0,52
5,2500 % Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 23(28/29)	XS2583203950	EUR	600	0	0	% 103,984	623.904,00	0,19
1,1250 % Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Preferred MTN 20(26/27)	XS2228245838	EUR	1.800	0	0	% 95,292	1.715.256,00	0,52
4,0000 % Banco de Sabadell S.A. EO-FLR Preferred MTN 24(29/30)	XS2745719000	EUR	3.000	3.000	0	% 101,449	3.043.470,00	0,92
1,6250 % Banco Santander S.A. EO-Medium-Term Nts 2020(30)	XS2247936342	EUR	1.400	0	0	% 86,375	1.209.250,00	0,37
4,8750 % Banco Santander S.A. EO-Non-Pref. MTN 2023(31)	XS2705604234	EUR	800	800	0	% 106,639	853.112,00	0,26
0,3000 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2019(26)	XS2063247915	EUR	2.000	500	0	% 92,671	1.853.420,00	0,56
3,7500 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 2024(34)	XS2743029840	EUR	1.200	1.200	0	% 100,976	1.211.712,00	0,37

## 4 Metzler Euro Corporates Sustainability Halbjahresbericht

### Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
0,5800 % Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 2019(20/29)	XS2038039074	EUR	3.200	0	0	% 88,702	2.838.464,00	0,86
4,8750 % Bank of Ireland Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2023(27/28)	XS2576362839	EUR	2.500	2.500	0	% 103,757	2.593.925,00	0,79
5,0000 % Bank of Ireland Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2023(30/31) <sup>1)</sup>	XS2643234011	EUR	2.500	1.100	0	% 106,711	2.667.775,00	0,81
6,7500 % Bank of Ireland Group PLC EO-FLR MTN 2022(27/33)	XS2561182622	EUR	1.350	0	0	% 107,071	1.445.458,50	0,44
4,8750 % Bankinter S.A. EO-FLR Non-Pref.Nts 23(30/31)	ES0213679OP3	EUR	1.400	0	0	% 105,253	1.473.542,00	0,45
3,8750 % Banque Stellantis France S.A. EO-Med.-Term Notes 2023(23/26)	FR001400F6V1	EUR	1.100	0	0	% 100,351	1.103.861,00	0,33
2,5000 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(27/32)	FR0014009HA0	EUR	3.000	0	0	% 95,012	2.850.360,00	0,86
1,3750 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(29)	FR0013422011	EUR	1.700	0	0	% 89,956	1.529.252,00	0,46
0,6250 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(32)	FR0014000UL9	EUR	2.200	0	0	% 77,518	1.705.396,00	0,52
4,1250 % BNP Paribas S.A. EO-Preferred MTN 2023(33)	FR001400I4X9	EUR	700	0	0	% 105,757	740.299,00	0,22
4,5000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 2022(22/31)	XS2555220941	EUR	2.000	0	0	% 107,098	2.141.960,00	0,65
1,4670 % BP Capital Markets B.V. EO-Bonds 2021(41)	XS2388557998	EUR	1.000	0	0	% 70,604	706.040,00	0,21
3,6250 % BP Capital Markets PLC EO-FLR Notes 2020(29/Und.)	XS2193662728	EUR	1.000	0	0	% 95,575	955.750,00	0,29
1,2310 % BP Capital Markets PLC EO-Medium-Term Nts 2019(31)	XS1992927902	EUR	500	0	0	% 86,424	432.120,00	0,13
3,6250 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(26)	FR001400HAC0	EUR	1.000	0	0	% 100,259	1.002.590,00	0,30
4,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2023(29)	FR001400GGZ0	EUR	1.500	1.500	0	% 103,319	1.549.785,00	0,47
0,2500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Non-Preferred MTN 2021(28)	FR001400I168	EUR	1.100	0	0	% 86,855	955.405,00	0,29
3,7500 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 24(34)	FR001400N6I8	EUR	2.000	2.000	0	% 101,429	2.028.580,00	0,61
4,3750 % CA Auto Bank S.p.A. EO-Med.-T. Notes 2023(26/26)	XS2633552026	EUR	2.000	0	0	% 101,110	2.022.200,00	0,61
0,5000 % CA Auto Bank S.p.A. EO-Med.-Term Nts 2019(24/24)	XS2051914963	EUR	2.000	0	0	% 98,477	1.969.540,00	0,60
4,7500 % CA Auto Bank S.p.A. EO-Medium-Term Nts 2023(26/27)	XS2708354811	EUR	1.500	1.500	0	% 102,429	1.536.435,00	0,47
0,6250 % Cadent Finance PLC EO-Med.-Term Nts 2021(21/30)	XS2320438653	EUR	1.550	0	0	% 84,524	1.310.122,00	0,40
4,2500 % Cadent Finance PLC EO-Med.-Term Nts 2023(23/29)	XS2641164491	EUR	1.800	0	0	% 103,547	1.863.846,00	0,56
6,2500 % Caixabank S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 2022(27/33)	XS2558978883	EUR	2.400	0	0	% 106,036	2.544.864,00	0,77
0,5000 % Caixabank S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(28/29)	XS2297549391	EUR	500	0	0	% 88,912	444.560,00	0,13
5,3750 % Caixabank S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 22(29/30)	XS2555187801	EUR	900	0	0	% 108,247	974.223,00	0,30
4,2500 % Caixabank S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(30)	XS2676814499	EUR	2.000	0	0	% 104,144	2.082.880,00	0,63
4,0000 % Carlsberg Breweries A/S EO-Medium-Term Nts 2023(23/28)	XS2696046460	EUR	900	0	0	% 102,786	925.074,00	0,28
4,3750 % Carrefour S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/31)	FR001400LUK3	EUR	1.500	1.500	0	% 105,246	1.578.690,00	0,48
4,3750 % Carrier Global Corp. EO-Notes 2024(24/25)	XS2751688743	EUR	1.300	1.300	0	% 100,565	1.307.345,00	0,40
1,5000 % Citigroup Inc. EO-Medium-Term Nts 2016(16/28)	XS1457608286	EUR	1.400	0	0	% 92,320	1.292.480,00	0,39

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

Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
1,2500 % CK Hutchison Eur.Fin.(18) Ltd. EO-Notes 2018(25)	XS1806124753	EUR	1.600	600	0	% 97,184	1.554.944,00	0,47
1,1000 % Coca-Cola Co., The EO-Notes 2016(16/36)	XS1485643610	EUR	1.000	0	0	% 78,524	785.240,00	0,24
4,6250 % Covivio S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/32)	FR001400MDV4	EUR	1.200	1.200	0	% 103,965	1.247.580,00	0,38
4,5000 % Crédit Agricole Assurances SA EO-FLR Notes 2014(25/Und.)	FR0012222297	EUR	2.000	0	1.200	% 100,216	2.004.320,00	0,61
4,2500 % Crédit Agricole Assurances SA EO-FLR Notes 2015(25/Und.)	FR0012444750	EUR	3.300	0	0	% 99,583	3.286.239,00	1,00
4,0000 % Crédit Agricole S.A. EO-FLR Notes 2020(27/Und.)	FR0013533999	EUR	1.300	0	0	% 93,857	1.220.141,00	0,37
1,8750 % Crédit Agricole S.A. EO-Non-Preferred MTN 2016(26)	XS1538284230	EUR	1.000	0	0	% 96,066	960.660,00	0,29
1,7500 % Crédit Agricole S.A. EO-Non-Preferred MTN 2019(29)	XS1958307461	EUR	1.400	0	0	% 92,216	1.291.024,00	0,39
1,8750 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.22(27/28)	DE000DL19WL7	EUR	5.000	0	0	% 94,188	4.709.400,00	1,43
3,7500 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.24(29/30)	DE000A3826R6	EUR	2.200	2.200	0	% 100,235	2.205.170,00	0,67
0,1250 % Deutsche Börse AG Anleihe v.21(21/31)	DE000A3H2465	EUR	700	0	0	% 82,358	576.506,00	0,17
0,7500 % DSV Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/33)	XS2360881549	EUR	1.000	0	0	% 78,494	784.940,00	0,24
2,5000 % Electrolux, AB EO-Medium-Term Nts 2022(22/30) <sup>1)</sup>	XS2475919663	EUR	1.300	0	0	% 92,203	1.198.639,00	0,36
3,3750 % ENEL S.p.A. EO-FLR Cap. Secs 2018(26/UN)	XS1713463559	EUR	1.700	400	0	% 97,071	1.650.207,00	0,50
2,2500 % ENEL S.p.A. EO-FLR Nts. 2020(26/Und.)	XS2228373671	EUR	800	800	0	% 93,611	748.888,00	0,23
1,3750 % ENEL S.p.A. EO-FLR Nts. 2021(21/Und.)	XS2312744217	EUR	2.800	0	0	% 89,098	2.494.744,00	0,76
3,2500 % Engie S.A. EO-FLR Notes 2019(24/Und.)	FR0013398229	EUR	600	0	0	% 99,017	594.102,00	0,18
1,8750 % Engie S.A. EO-FLR Notes 2021(21/Und.)	FR00140046Y4	EUR	1.200	0	0	% 83,595	1.003.140,00	0,30
4,0000 % Engie S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/35)	FR001400F1I9	EUR	1.400	0	0	% 103,039	1.442.546,00	0,44
1,6590 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2018(18/24)	XS1811024543	EUR	2.200	0	0	% 99,749	2.194.478,00	0,67
2,0450 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2019(19/28)	XS2062490649	EUR	400	0	0	% 87,223	348.892,00	0,11
1,8160 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2021(21/31)	XS2304675791	EUR	3.200	2.500	0	% 79,832	2.554.624,00	0,77
0,2500 % Erste Group Bank AG EO-Pref. Med.-T.Nts 21(31)	AT0000A2N837	EUR	1.300	0	0	% 81,524	1.059.812,00	0,32
4,0000 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-Med.-Term Nts 2022(29/29)	XS2536502227	EUR	2.000	2.000	0	% 103,178	2.063.560,00	0,63
6,0000 % Gothaer Allgem.Versicherung AG FLR-Nachr.-Anl. v.15(25/45)	DE000A168478	EUR	4.300	300	0	% 101,574	4.367.682,00	1,32
1,5000 % Grand City Properties S.A. EO-FLR Med-T. Nts 20(21/UND.)	XS2271225281	EUR	2.300	1.000	0	% 64,646	1.486.858,00	0,45
2,6250 % Heimstaden Bostad AB EO-FLR Notes 2021(21/Und.)	XS2294155739	EUR	600	0	0	% 60,749	364.494,00	0,11
0,2500 % Heimstaden Bostad Treasury B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/24)	XS2397239000	EUR	1.800	0	0	% 96,382	1.734.876,00	0,53
1,6250 % Heimstaden Bostad Treasury B.V. EO-Medium-Term Nts 2021(21/31)	XS2397252011	EUR	1.000	0	0	% 70,443	704.430,00	0,21
3,8750 % Heineken N.V. EO-Medium-Term Nts 2023(24)	XS2599731473	EUR	900	0	0	% 99,991	899.919,00	0,27
4,1250 % ING Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 2023(26)	XS2697483118	EUR	1.200	0	0	% 101,795	1.221.540,00	0,37

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

## 6 Metzler Euro Corporates Sustainability Halbjahresbericht

### Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
5,2500 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(32/33)	XS2554745708	EUR	1.300	0	0	% 111,209	1.445.717,00	0,44
1,0000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 19(25/30)	XS2079079799	EUR	1.500	0	0	% 94,944	1.424.160,00	0,43
2,5000 % Inmobiliaria Colonial SOCIMI EO-Medium-Term Nts 2017(17/29)	XS1725678194	EUR	2.500	0	0	% 93,815	2.345.375,00	0,71
6,1840 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 23(28/34)	XS2589361240	EUR	2.500	0	0	% 106,442	2.661.050,00	0,81
5,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Non-Preferred MTN 23(33)	XS2592658947	EUR	1.400	0	0	% 110,955	1.553.370,00	0,47
4,3750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(27)	XS2673808486	EUR	800	800	0	% 102,530	820.240,00	0,25
5,1250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(31)	XS2673808726	EUR	1.500	1.500	0	% 108,629	1.629.435,00	0,49
0,3000 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2020(20/28)	XS2115091717	EUR	2.000	0	0	% 89,852	1.797.040,00	0,54
0,6500 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 2020(20/32)	XS2115091808	EUR	1.200	0	0	% 81,921	983.052,00	0,30
1,8000 % Intl Flavors & Fragrances Inc. EO-Notes 2018(18/26)	XS1843459782	EUR	3.700	0	1.300	% 95,412	3.530.244,00	1,07
1,0470 % JPMorgan Chase & Co. EO-FLR Med.-T. Nts 2019(19/32)	XS2075811948	EUR	2.500	0	0	% 84,358	2.108.950,00	0,64
1,9630 % JPMorgan Chase & Co. EO-FLR Med.-T. Nts 2022(22/30)	XS2461234622	EUR	1.000	0	0	% 93,439	934.390,00	0,28
4,3750 % KBC Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 2023(31)	BE0002951326	EUR	2.100	0	0	% 105,840	2.222.640,00	0,67
3,8750 % Klépierre S.A. EO-Med.-Term Notes 2024(24/33)	FR001400NDQ2	EUR	1.000	1.000	0	% 99,883	998.830,00	0,30
0,7500 % LEG Immobilien SE Medium Term Notes v.21(21/31)	DE000A3E5VK1	EUR	1.100	0	0	% 80,197	882.167,00	0,27
0,3750 % LEG Immobilien SE Medium Term Notes v.22(22/26) <sup>1)</sup>	DE000A3MQNN9	EUR	1.500	0	0	% 93,984	1.409.760,00	0,43
2,3750 % Louis Dreyfus Company Fin.B.V. EO-Notes 2020(20/25)	XS2264074647	EUR	2.000	0	0	% 97,612	1.952.240,00	0,59
3,6250 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2023(24)	DE000A3LJT71	EUR	1.000	0	0	% 99,862	998.620,00	0,30
3,0000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2024(27)	DE000A3LSYG8	EUR	2.000	2.000	0	% 99,388	1.987.760,00	0,60
4,8750 % Metso Oyj EO-Medium-Term Nts 2022(22/27)	XS2560415965	EUR	1.000	0	0	% 104,376	1.043.760,00	0,32
4,3750 % Metso Oyj EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	XS2717378231	EUR	1.000	1.000	0	% 103,191	1.031.910,00	0,31
0,4950 % Morgan Stanley EO-FLR M.-Term Nts 2020(21/29)	XS2250008245	EUR	1.000	0	0	% 87,292	872.920,00	0,26
5,1480 % Morgan Stanley EO-FLR Med.-T. Nts 2022(23/34)	XS2548081053	EUR	2.500	2.500	0	% 110,785	2.769.625,00	0,84
4,6560 % Morgan Stanley EO-FLR Med.-T. Nts 2023(23/29)	XS2595028536	EUR	1.400	1.400	0	% 103,690	1.451.660,00	0,44
1,0540 % National Grid North Amer. Inc. EO-Med.-Term Nts 2022(22/31)	XS2434710872	EUR	1.400	0	0	% 84,361	1.181.054,00	0,36
3,2450 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 2022(22/34)	XS2486461523	EUR	1.200	0	0	% 95,062	1.140.744,00	0,35
3,3750 % Nederlandse Gasunie, N.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/34)	XS2498042584	EUR	1.200	0	0	% 100,118	1.201.416,00	0,36
1,6250 % NGG Finance PLC EO-FLR Notes 2019(24/79)	XS2010044977	EUR	1.800	0	0	% 98,243	1.768.374,00	0,54
4,3750 % Nokia Oyj EO-Medium-Term Notes 23(23/31)	XS2488809612	EUR	1.500	0	0	% 102,203	1.533.045,00	0,46
2,8750 % OMV AG EO-FLR Notes 2018(24/Und.)	XS1713462403	EUR	1.400	0	0	% 99,596	1.394.344,00	0,42
5,5000 % Praemia Healthcare SAS EO-Obl. 2023(23/28)	FR001400KL23	EUR	1.700	0	0	% 104,853	1.782.501,00	0,54

<sup>1)</sup> Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen übertragen.

**Vermögensaufstellung zum 31. März 2024**

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
4,5000 % RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(27/27)	FR001400H2O3	EUR	1.700	0	0	% 101,875	1.731.875,00	0,52
4,8750 % RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(29/29)	FR001400KY69	EUR	1.500	1.500	0	% 104,547	1.568.205,00	0,48
3,8750 % RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(28/29) <sup>1)</sup>	FR001400N3F1	EUR	1.300	1.500	200	% 100,019	1.300.247,00	0,39
2,1250 % Royal Bank of Canada EO-Medium-Term Notes 2022(29)	XS2472603740	EUR	1.000	0	0	% 94,035	940.350,00	0,28
2,0000 % Royal Schiphol Group N.V. EO-Medium Term Nts 2015(26/26)	XS1301052202	EUR	1.100	0	0	% 96,806	1.064.866,00	0,32
3,3750 % Sampo OYJ EO-FLR Notes 2019(29/49)	XS1995716211	EUR	1.800	0	0	% 95,125	1.712.250,00	0,52
4,5000 % Schaeffler AG MTN v.2024(2024/2030)	DE000A383HC1	EUR	1.500	1.500	0	% 99,780	1.496.700,00	0,45
3,2500 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 2024(24/35)	FR001400N285	EUR	1.000	1.000	0	% 100,203	1.002.030,00	0,30
3,2500 % SCOR SE EO-FLR Notes 2015(27/47)	FR0012770063	EUR	1.200	0	300	% 96,332	1.155.984,00	0,35
3,5000 % SES S.A. EO-Med.-Term Nts 2022(22/29)	XS2489775580	EUR	2.600	900	0	% 98,398	2.558.348,00	0,78
3,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Med.-Term Nts 2024(36/37)	XS2769892865	EUR	1.200	1.200	0	% 100,070	1.200.840,00	0,36
3,6250 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Med.-Term Nts 2024(43/44)	XS2769892600	EUR	1.000	1.000	0	% 101,360	1.013.600,00	0,31
1,7500 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 2019(39)	XS1955187932	EUR	500	0	0	% 81,506	407.530,00	0,12
0,2500 % SKF AB EO-Notes 2021(21/31)	XS2297204815	EUR	2.500	0	0	% 80,282	2.007.050,00	0,61
1,0000 % Snam S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2019(34/34)	XS2051660509	EUR	800	0	0	% 77,066	616.528,00	0,19
3,8750 % Snam S.p.A. EO-Med.-Term Nts 2024(24/34)	XS2767499945	EUR	2.300	2.300	0	% 100,866	2.319.918,00	0,70
4,0000 % SSE PLC EO-FLR Notes 2022(28/Und.)	XS2439704318	EUR	3.500	0	0	% 97,709	3.419.815,00	1,04
1,5000 % Stedin Holding N.V. EO-FLR Notes 2021(21/Und.)	XS2314246526	EUR	800	0	0	% 91,781	734.248,00	0,22
4,2500 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2023(23/31)	XS2634690114	EUR	1.000	0	0	% 104,122	1.041.220,00	0,32
4,5000 % Suez S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33)	FR001400LZO4	EUR	1.200	1.200	0	% 105,809	1.269.708,00	0,38
4,3750 % Sydney Airport Fin.Co.Pty Ltd. EO-Medium-Term Nts 2023(23/33)	XS2613209670	EUR	1.000	0	0	% 105,047	1.050.470,00	0,32
4,0000 % Talanx AG MTN v.2022(2029/2029)	XS2547609433	EUR	600	600	0	% 102,938	617.628,00	0,19
1,6250 % Telia Company AB EO-Med.-Term Notes 2015(15/35)	XS1193213953	EUR	300	0	0	% 84,791	254.373,00	0,08
0,1250 % Telia Company AB EO-Med.-Term Notes 2020(20/30)	XS2264161964	EUR	1.000	0	0	% 82,275	822.750,00	0,25
1,9520 % Toronto-Dominion Bank, The EO-Medium-Term Notes 2022(30)	XS2466350993	EUR	1.000	0	0	% 92,546	925.460,00	0,28
2,1250 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 21(21/Und.)	XS2290960876	EUR	7.400	5.500	0	% 82,188	6.081.912,00	1,84
2,0000 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 22(22/Und.)	XS2432130610	EUR	700	0	0	% 93,438	654.066,00	0,20
3,2500 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 22(22/Und.)	XS2432131188	EUR	1.500	0	0	% 85,796	1.286.940,00	0,39
3,1250 % Toyota Motor Finance (Neth.)BV EO-Medium-Term Notes 2024(27)	XS2744121869	EUR	2.000	2.000	0	% 99,390	1.987.800,00	0,60
1,4500 % Transurban Finance Co. Pty Ltd EO-Medium-Term Nts 2019(19/29)	XS1997077364	EUR	800	0	0	% 90,754	726.032,00	0,22
3,2500 % UBS Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2020(20/26)	CH0537261858	EUR	1.500	1.500	0	% 99,169	1.487.535,00	0,45
4,1250 % UBS Group AG EO-FLR Med.-T. Nts 2024(32/33)	CH1305916897	EUR	3.600	3.600	0	% 101,637	3.658.932,00	1,11

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

## 8 Metzler Euro Corporates Sustainability Halbjahresbericht

### Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
0,8750 % UBS Group AG EO-Medium-Term Nts 2021(31)	CH1142231690	EUR	1.800	0	0	% 81,595	1.468.710,00	0,45
7,2500 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-FLR Bonds 2023(23/Und.)	FR001400IU83	EUR	1.300	0	0	% 106,331	1.382.303,00	0,42
4,1250 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 2023(23/30)	FR001400MLN4	EUR	1.000	1.000	0	% 101,615	1.016.150,00	0,31
5,3750 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 24(29/34)	IT0005580102	EUR	1.400	1.400	0	% 102,793	1.439.102,00	0,44
4,8000 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Pref. MTN 23(28/29)	XS2577053825	EUR	2.000	0	0	% 104,304	2.086.080,00	0,63
4,1250 % V.F. Corp. EO-Notes 2023(23/26)	XS2592659242	EUR	750	0	0	% 98,944	742.080,00	0,22
4,2500 % V.F. Corp. EO-Notes 2023(23/29)	XS2592659671	EUR	1.000	0	0	% 98,625	986.250,00	0,30
2,2500 % Veolia Environnement S.A. EO-FLR Notes 2020(26/Und.)	FR00140007K5	EUR	1.600	0	0	% 95,398	1.526.368,00	0,46
1,3750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2017(17/26)	XS1708161291	EUR	1.150	0	0	% 95,501	1.098.261,50	0,33
0,8750 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2019(19/32)	XS2052320954	EUR	1.500	0	0	% 82,646	1.239.690,00	0,38
0,7500 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 2021(21/32) Reg.S	XS2320759884	EUR	1.100	0	0	% 81,859	900.449,00	0,27
2,0000 % Vesteda Finance B.V. EO-Med.-Term Notes 2018(18/26)	XS1854166078	EUR	1.000	0	0	% 95,920	959.200,00	0,29
0,5000 % Vier Gas Transport GmbH Med.Term.Notes v.2019(19/34)	XS2049146215	EUR	200	0	0	% 73,740	147.480,00	0,04
4,6250 % Vier Gas Transport GmbH Med.Term.Notes v.2022(22/32)	XS2535725159	EUR	1.500	0	0	% 107,376	1.610.640,00	0,49
2,7500 % Vonovia SE EO-Medium-Term Nts 2018(18/38)	DE000A19X8C0	EUR	400	0	0	% 84,285	337.140,00	0,10
1,1250 % Vonovia SE EO-Medium-Term Nts 2019(34/34)	DE000A2R7JE1	EUR	1.000	0	0	% 74,227	742.270,00	0,22
1,6250 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/51)	DE000A3MP4W5	EUR	600	0	0	% 57,911	347.466,00	0,11
4,7500 % Vonovia SE Medium Term Notes v.22(22/27)	DE000A30VQA4	EUR	1.000	0	0	% 102,695	1.026.950,00	0,31
1,3750 % Wendel SE EO-Obl. 2022(22/34)	FR0014006VH2	EUR	1.500	0	0	% 81,423	1.221.345,00	0,37
0,9540 % Wesfarmers Ltd. EO-Medium-Term Nts 2021(21/33)	XS2399154181	EUR	2.400	0	0	% 79,628	1.911.072,00	0,58
6,1250 % ZF Europe Finance B.V. EO-Med.-Term Nts 2023(23/29)	XS2681541327	EUR	900	0	0	% 106,288	956.592,00	0,29
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>						<b>EUR</b>	<b>61.428.442,00</b>	<b>18,62</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>						<b>EUR</b>	<b>61.428.442,00</b>	<b>18,62</b>
3,3750 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. EO-Notes 2024(24/31)	XS2780025271	EUR	1.200	1.200	0	% 100,637	1.207.644,00	0,37
2,6250 % Allianz SE FLR-Sub.Ter.Nts.v.20(30/unb.)	DE000A289FK7	EUR	5.800	0	0	% 78,886	4.575.388,00	1,39
0,6250 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd. EO-Med.-Term Nts 2020(20/30)	XS2118213888	EUR	1.300	0	0	% 83,795	1.089.335,00	0,33
6,0000 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Notes 2020(26/Und.)	ES0813211028	EUR	1.600	0	0	% 100,019	1.600.304,00	0,48
2,2500 % Branicks Group AG Anleihe v.2021(2021/2026)	XS2388910270	EUR	1.500	0	0	% 33,196	497.940,00	0,15
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/07 f.19.06.24	DE000BU0E063	EUR	5.000	5.000	0	% 99,221	4.961.050,00	1,50
5,8750 % CaixaBank S.A. EO-FLR Notes 2020(27/Und.)	ES0840609020	EUR	1.200	0	0	% 98,556	1.182.672,00	0,36
0,8750 % Czech Gas Netw.Invest.S.à r.l. EO-Notes 2021(21/31)	XS2322438990	EUR	1.300	0	0	% 81,757	1.062.841,00	0,32
3,9760 % East Japan Railway Co. EO-Medium-Term Notes 2023(32)	XS2673433814	EUR	900	0	0	% 105,648	950.832,00	0,29
4,3890 % East Japan Railway Co. EO-Medium-Term Notes 2023(43)	XS2673437484	EUR	900	900	0	% 107,588	968.292,00	0,29
3,7500 % Elia Transm. Belgium N.V. EO-Medium-Term Nts 2024(24/36)	BE6349118800	EUR	1.000	1.000	0	% 101,152	1.011.520,00	0,31

Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
3,7500 % ELM B.V. EO-FLR M.-T. Nts 2020(25/Und.)	XS2182055009	EUR	6.900	0	0	% 98,715	6.811.335,00	2,06
1,6250 % Engie S.A. EO-FLR Notes 2019(25/Und.)	FR0013431244	EUR	1.300	0	0	% 96,819	1.258.647,00	0,38
1,6980 % EP Infrastructure a.s. EO-Notes 2019(19/26)	XS2034622048	EUR	1.100	0	0	% 91,979	1.011.769,00	0,31
1,8740 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	XS2244941063	EUR	1.800	0	0	% 95,190	1.713.420,00	0,52
1,4500 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Notes 2021(21/Und.)	XS2295335413	EUR	400	0	0	% 92,096	368.384,00	0,11
0,6250 % Kerry Group Financial Services EO-Notes 2019(19/29)	XS2042667944	EUR	1.400	0	0	% 87,028	1.218.392,00	0,37
1,8750 % Mandatum Life Insurance Co.Ltd EO-FLR Notes 2019(24/49)	XS2053053273	EUR	1.500	0	0	% 98,697	1.480.455,00	0,45
0,6250 % Mölnlycke Holding AB EO-Medium-Term Nts 2020(20/31)	XS2270406452	EUR	2.500	0	0	% 80,729	2.018.225,00	0,61
1,6250 % ProLogis Intl Funding II S.A. EO-Med.-Term Nts 2020(20/32)	XS2187529180	EUR	800	0	0	% 84,301	674.408,00	0,20
3,6250 % ProLogis Intl Funding II S.A. EO-Med.-Term Nts 2022(22/30)	XS2529520715	EUR	800	0	0	% 99,513	796.104,00	0,24
4,3750 % Santander Consumer Bank AG EO Med.-Term Notes 2023(27)	XS2679878319	EUR	1.700	0	0	% 101,891	1.732.147,00	0,52
4,8750 % Sartorius Finance B.V. EO-Notes 2023(23/35)	XS2676395408	EUR	2.400	1.500	0	% 107,989	2.591.736,00	0,79
7,1250 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Notes 2022(22/Und.)	XS2462605671	EUR	1.500	0	0	% 109,188	1.637.820,00	0,50
1,3750 % Telia Company AB EO-FLR Securities 2020(26/81)	XS2082429890	EUR	1.000	0	0	% 94,250	942.500,00	0,29
1,3750 % Telstra Corp. Ltd. EO-Med.-Term Notes 2019(19/29)	XS1966038249	EUR	700	0	0	% 91,845	642.915,00	0,19
7,3750 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2023(23/29) <sup>1)</sup>	XS2592804434	EUR	1.800	1.800	0	% 110,926	1.996.668,00	0,61
2,0000 % Thermo Fisher Scient.(Fin.)BV EO-Notes 2021(21/51)	XS2366415540	EUR	1.400	0	0	% 72,425	1.013.950,00	0,31
1,7500 % TotalEnergies SE EO-FLR Med.-T. Nts 19(24/Und.)	XS1974787480	EUR	3.200	0	0	% 100,000	3.200.000,00	0,97
3,0000 % Transurban Finance Co. Pty Ltd EO-Medium-Term Nts 2020(20/30)	XS2152883406	EUR	800	0	0	% 97,373	778.984,00	0,24
1,9080 % Upjohn Finance B.V. EO-Notes 2020(20/32)	XS2193983108	EUR	5.000	3.900	0	% 84,495	4.224.750,00	1,28
2,4985 % Wintershall Dea Finance 2 B.V. EO-FLR Bonds 2021(21/Und.)	XS2286041517	EUR	2.400	0	0	% 92,566	2.221.584,00	0,67
0,8400 % Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/25)	XS2054209833	EUR	2.200	0	0	% 95,368	2.098.096,00	0,64
1,8230 % Wintershall Dea Finance B.V. EO-Notes 2019(19/31)	XS2055079904	EUR	500	0	0	% 84,540	422.700,00	0,13
1,3750 % WPP Finance 2016 EO-Med.-T.Nts 2018(18/25)	XS1794084068	EUR	1.500	0	0	% 97,709	1.465.635,00	0,44
<b>Summe Wertpapiervermögen <sup>2)</sup></b>						<b>EUR</b>	<b>323.358.769,50</b>	<b>97,99</b>

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

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

## 10 Metzler Euro Corporates Sustainability Halbjahresbericht

### Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 31.03.2024	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
<b>Derivate</b> (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)				<b>EUR</b>	<b>-24.980,00</b>	<b>-0,01</b>
<b>Zins-Derivate</b> Forderungen/Verbindlichkeiten				<b>EUR</b>	<b>-24.980,00</b>	<b>-0,01</b>
<b>Zinsterminkontrakte</b>				<b>EUR</b>	<b>-24.980,00</b>	<b>-0,01</b>
FUTURE EURO-BOBL 06.06.24 EUREX	185	EUR	5.100.000		22.950,00	0,01
FUTURE EURO-BUND 06.06.24 EUREX	185	EUR	-7.100.000		-73.130,00	-0,02
FUTURE EURO-BUXL 06.06.24 EUREX	185	EUR	1.000.000		25.200,00	0,01
FUTURE EURO-SCHATZ 06.06.24 EUREX	185	EUR	26.000.000		0,00	0,00
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>				<b>EUR</b>	<b>2.388.648,29</b>	<b>0,72</b>
<b>Bankguthaben</b> EUR-Guthaben bei: B. Metzler seel Sohn & Co. AG		EUR	2.388.648,29	% 100,000	2.388.648,29	0,72
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>				<b>EUR</b>	<b>4.385.040,13</b>	<b>1,33</b>
Zinsansprüche		EUR	4.251.407,03		4.251.407,03	1,29
Einschüsse (Initial Margins)		EUR	133.633,10		133.633,10	0,04
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>				<b>EUR</b>	<b>-128.606,11</b>	<b>-0,04</b>
Zinsverbindlichkeiten		EUR	-172,13		-172,13	0,00
Verwaltungsvergütung		EUR	-87.795,75		-87.795,75	-0,03
Verwahrstellenvergütung		EUR	-25.084,51		-25.084,51	-0,01
Lagerstellenkosten		EUR	-15.553,72		-15.553,72	0,00
<b>Fondsvermögen</b>				<b>EUR</b>	<b>329.978.871,81</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>
<b>Metzler Euro Corporates Sustainability AI</b>						
Anteilwert				EUR	118,49	
Ausgabepreis				EUR	118,49	
Rücknahmepreis				EUR	118,49	
Anzahl Anteile				STK	2.784.756	

1) 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:						
XS2643234011	Bank of Ireland Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2023(30/31)	EUR	2.500,00	0,00	2.667.775,00	
XS2475919663	Electrolux, AB EO-Medium-Term Nts 2022(22/30)	EUR	1.300,00	0,00	1.198.639,00	
DE000A3MQNN9	LEG Immobilien SE Medium Term Notes v.22(22/26)	EUR	1.500,00	0,00	1.409.760,00	
FR001400N3F1	RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 2024(28/29)	EUR	1.300,00	0,00	1.300.247,00	
XS2592804434	Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 2023(23/29)	EUR	1.800,00	0,00	1.996.668,00	
Gesamtbetrag der Rückerstattungsansprüche aus Wertpapier-Darlehen			EUR	0,00	8.573.089,00	8.573.089,00

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

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

**Marktschlüssel**

**Terminbörsen**

185

Eurex Deutschland

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
4,5000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 2022(34)	XS2557084733	EUR	0	1.600
0,3750 % Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. EO-Notes 2021(21/30) Reg.S	XS2317288301	EUR	0	1.400
1,1250 % Argentum Netherlands B.V. EO-M-T.LPN 18(25/25)A Givaudan	XS1875331636	EUR	0	1.600
5,5000 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 15(27/47)	XS1311440082	EUR	0	3.300
1,0000 % ASTM S.p.A. EO-Med.-T. Nts 2021(21/26)	XS2412267358	EUR	0	1.800
1,3750 % Banco Santander S.A. EO-Non-Preferred MTN 2020(26)	XS2168647357	EUR	0	600
1,0000 % Bank of Ireland Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2019(24/25)	XS2082969655	EUR	0	2.000
1,2500 % Bankinter S.A. EO-FLR Notes 2021(27/32)	ES02136790F4	EUR	0	1.500
0,8750 % Bankinter S.A. EO-Non-Pref. Obl. 2019(26)	ES0213679HN2	EUR	0	1.500
5,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 2023(33)	FR001400F323	EUR	0	1.500
4,0000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Non-Preferred MTN 2023(33)	FR001400FBR0	EUR	0	2.000
4,1250 % Carrier Global Corp. EO-Notes 2024(24/28)	XS2751688826	EUR	700	700
2,0000 % Crédit Agricole S.A. EO-Medium-Term Nts 2019(29)	XS1968706108	EUR	0	500
5,9430 % EDP - Energias de Portugal SA EO-FLR Med.-T. Nts 2023(23/83)	PTEDP40M0025	EUR	0	600
1,0000 % Erste Group Bank AG EO-FLR Med.-T. Nts 2019(25/30)	XS2083210729	EUR	0	600
2,0000 % Gecina S.A. EO-Med.-Term Nts 2017(17/32)	FR0013266368	EUR	0	600
0,8750 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-Medium-Term Nts 2020(30)	XS2107332640	EUR	0	1.800
0,6410 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2021(21/29)	XS2388491289	EUR	0	900
1,7500 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 2019(29)	XS2022424993	EUR	0	900
3,1250 % Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 2022(29/30)	XS2521027446	EUR	0	1.900
1,3750 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 2020(20/40)	XS2238792332	EUR	0	1.200
0,8750 % Praemia Healthcare SAS EO-Obl. 2019(19/29)	FR0013457967	EUR	0	1.000
3,9700 % Sandoz Finance B.V. EO-Notes 2023(23/27)	XS2715297672	EUR	1.200	1.200
4,5000 % Sandoz Finance B.V. EO-Notes 2023(23/33)	XS2715941949	EUR	600	600
4,5000 % Schaeffler AG MTN v.2024(2024/2026)	DE000A3823R3	EUR	800	800
0,8750 % SES S.A. EO-Med.-Term Nts 2019(27/27)	XS2075811781	EUR	0	1.000
2,0000 % Smiths Group PLC EO-Med.-Term Notes 2017(17/27)	XS1570260460	EUR	0	1.000
1,7500 % SSE PLC EO-Med.-Term Notes 2020(20/30)	XS2156787173	EUR	0	700
4,5000 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28)	XS2199351375	EUR	0	1.800
2,0000 % Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. EO-Notes 2020(20/40)	XS2198582301	EUR	0	1.200
2,5000 % Talanx AG Notes v.2014(2026)	DE000TLX2102	EUR	0	700
2,3740 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 2020(20/Und.)	XS2207430120	EUR	0	700
0,3750 % Tesco Corp. Treas. Serv. PLC EO-Medium-Term Nts 2021(21/29)	XS2289877941	EUR	0	1.000
0,9250 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Preferred MTN 22(27/28)	XS2433139966	EUR	0	1.700

**An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere**

<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
1,5000 % Ausnet Services Hldgs Pty Ltd. EO-Med.-Term Nts 2015(15/27)	XS1191877452	EUR	0	650
4,3750 % Carrier Global Corp. EO-Notes 2023(23/25) Reg.S	XS2723569559	EUR	1.300	1.300
4,1250 % Carrier Global Corp. EO-Notes 2023(23/28) Reg.S	XS2723575879	EUR	700	700
1,0000 % Czech Gas Netw.Invest.S.à r.l. EO-Notes 2020(20/27)	XS2193733503	EUR	0	2.000
2,3750 % Forvia SE EO-Notes 2019(19/27)	XS2081474046	EUR	0	2.000
4,2500 % Mölnlycke Holding AB EO-Medium-Term Nts 2023(23/28)	XS2672967234	EUR	0	1.400
2,6250 % Samhallsbyggnadsbol.1 Nord AB EO-FLR Cap. 2020(25/Und.)	XS2272358024	EUR	0	1.600
4,2500 % Sartorius Finance B.V. EO-Notes 2023(23/26)	XS2678111050	EUR	0	600
4,5000 % Sartorius Finance B.V. EO-Notes 2023(23/32)	XS2676395317	EUR	1.600	1.600
4,5650 % Smith & Nephew PLC EO-Notes 2022(22/29)	XS2532473555	EUR	0	4.500
3,1250 % Utah Acquisition Sub Inc. EO-Notes 2016(16/28)	XS1492458044	EUR	0	3.200

**Nichtnotierte Wertpapiere<sup>1)</sup>**

<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/01 f.17.01.24	DE000BU0E014	EUR	20.000	20.000
2,7500 % Elia Group EO-FLR Nts 2018(23/Und.)	BE0002597756	EUR	0	200
2,6250 % Sigma Alimentos S.A. EO-Notes 2017(17/24) Reg.S	XS1562623584	EUR	0	2.100
4,8750 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Med.-T. Nts 19(24/29)	XS1953271225	EUR	0	600

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

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

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile Whg. in 1.000	Volumen in 1.000
<b>Derivate</b>		
(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)		
<b>Terminkontrakte</b>		
<b>Zinsterminkontrakte</b>		
Gekaufte Kontrakte: (Basiswert(e): EURO-BOBL, EURO-BUXL, EURO-SCHATZ)	EUR	64.549,07
Verkaufte Kontrakte: (Basiswert(e): EURO-BUND)	EUR	57.319,82
<b>Wertpapier-Darlehen</b> <b>(Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluß des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes):</b>		
unbefristet (Basiswert(e): AIB Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 2023(30/31), alstria office REIT-AG Anleihe v.2019(2019/2025), Aroundtown SA EO-Med.-Term Notes 2021(21/27), Branicks Group AG Anleihe v.2021(2021/2026), Covivio S.A. EO-Medium-Term Nts 2023(23/32), Crédit Agricole S.A. EO-FLR Notes 2020(27/Und.), Czech Gas Netw.Invest.S.à r.l. EO-Notes 2020(20/27), Heimstaden Bostad AB EO-FLR Notes 2021(21/Und.), LEG Immobilien SE Medium Term Notes v.21(21/31), Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 2023(24), Nederlandse Gasunie, N.V. EO-Medium-Term Nts 2022(22/34), Siemens Finan.maatschappij NV EO-Med.-Term Nts 2024(36/37), Siemens Finan.maatschappij NV EO-Med.-Term Nts 2024(43/44), Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 2020(20/28), Talanx AG Notes v.2014(2026), Toronto-Dominion Bank, The EO-Medium-Term Notes 2022(30), V.F. Corp. EO-Notes 2023(23/26), V.F. Corp. EO-Notes 2023(23/29), Verizon Communications Inc. EO-Notes 2019(19/32), Vonovia SE EO-Medium-Term Nts 2018(18/38))		
	EUR	16.928

**Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV**

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>97,99</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>-0,01</b>

**Sonstige Angaben**

**Metzler Euro Corporates Sustainability AI**

Anteilwert	EUR	118,49
Ausgabepreis	EUR	118,49
Rücknahmepreis	EUR	118,49
Anzahl Anteile	STK	2.784.756

**Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände**

**Bewertung**

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	8.573.089,00
in % des Fondsvermögens		2,60

**Größte Gegenpartei(en) von Wertpapierleihegeschäften**

Rang	Name	Bruttovolumen der offenen Geschäfte in EUR	Sitzstaat
1	B. Metzler seel Sohn & Co. AG (G) (V)	8.573.089,00	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	8.573.089,00

**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	9.669.225,00

**Größte Sicherheitenanbieter, bezogen auf die erhaltenen Wertpapiersicherheiten für Wertpapierleihegeschäfte**

Rang	Name	Volumen empfangene Sicherheiten in EUR
1	Amsterdam, Stadt	7.445.100,00
2	Sparebank 1 SR-Bank ASA	2.224.125,00

**Verwahrer / Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus Wertpapierleihegeschäften**

Gesamtzahl der Verwahrer / Kontoführer	1
Name	verwahrter Betrag absolut
B. Metzler seel Sohn & Co. AG (G) (V)	9.669.225,00

**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	18.437,74	50,00 %
Kapitalverwaltungsgesellschaft	3.687,55	10,00 %
Dritter	14.750,19	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 Stichtag<sup>1)</sup>**

Anteil der verliehenen Wertpapiere 2,65 %

**Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten**

Die durch den Fonds erhaltenen Wertpapiersicherheiten werden nicht weiterverwendet.

1) 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 26. April 2024

**Metzler Asset Management GmbH**  
Die Geschäftsführung

**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](http://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](http://www.metzler.com)