



Halbjahresabschluss zum 31. Dezember 2019

Oddo BHF European Convertibles

Investmentfonds nach französischem Recht (Fonds Commun de Placement)

Informationen für Anteilhaber in der Bundesrepublik Deutschland

Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Vertragsbedingungen des Fonds sowie die Jahres- und Halbjahresberichte – jeweils in Papierform – sowie der Nettoinventarwert pro Anteil und die Ausgabe- und Rücknahmepreise sind kostenlos bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle erhältlich. Die vorgenannten Dokumente werden in englischer Sprache zur Verfügung gestellt, mit Ausnahme der wesentlichen Anlegerinformationen, die in deutscher Sprache verfügbar sind.

Ab dem 1. Januar 2020 wird ODDO BHF Asset Management, Bockenheimer Landstraße 10, 60323 Frankfurt am Main, die deutsche Zahl- und Informationsstelle sein.

DER HALBJAHRESBERICHT WIRD VOM ABSCHLUSSPRÜFER DES OGAW NICHT MIT EINEM PRÜFUNGSVERMERK VERSEHEN.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Bestandteile des Fondsvermögens	Betrag zum Abschluss des Berichtszeitraums *
a) in Artikel L. 214-24-55, Abschnitt I, Absatz 1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) aufgeführte Finanztitel	100.625.646,58
b) Guthaben bei Kreditinstituten	4.864.571,54
c) sonstige von dem OGA gehaltene Vermögenswerte	27.267.217,80
d) von dem OGA gehaltene Vermögenswerte insgesamt	132.757.435,92
e) Passiva	-23.111.741,04
f) Nettoinventarwert	109.645.694,88

* Negative Beträge sind mit einem Minuszeichen gekennzeichnet

ANZAHL DER IN UMLAUF BEFINDLICHEN ANTEILE ODER AKTIEN UND NETTOINVENTARWERT

Anteil	Anteilstyp	Nettovermögen pro Anteil	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert
OddConvE A C	Thesaurierung	34.277.902,62	254.724,55	134,56
OddEuCon B C	Thesaurierung	44.150.993,85	314.182,06	140,52
OddConvE GC C	Thesaurierung	1.303.233,14	13.008,53	100,18
OddEurConv CN C	Thesaurierung	12.252.591,75	122.894,31	99,70
OddConvE Di Di	Ausschüttung	17.660.973,52	163.130,00	108,26

BESTANDTEILE DES WERTPAPIERPORTFOLIOS

Bestandteile des Wertpapierportfolios:	Prozentualer Anteil	
	Nettovermögen	Vermögen insgesamt
a) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gemäß Artikel L. 422-1 des Code Monétaire et Financier gehandelt werden	89,60	74,00
b) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt gehandelt werden, der sich in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder einem anderen Staat befindet, der dem Europäischen Wirtschaftsraum angehört	0,00	0,00
c) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittstaats zugelassen sind oder an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt eines Drittstaats gehandelt werden, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf einer von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde veröffentlichten Liste steht oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Markts per Gesetz oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,96	0,79
d) In Artikel R. 214-11, Abschnitt I, Absatz 4 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) aufgeführte neu emittierte Finanztitel	0,00	0,00
e) Sonstige Vermögenswerte: Es handelt sich um die in Artikel R. 214-11, Abschnitt II des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) aufgeführten Vermögenswerte	4,33	3,58

AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE NACH WÄHRUNG

Titel	Währung	Betrag (EUR)	Prozentualer Anteil	
			Nettovermögen	Vermögen insgesamt
Telecom Italia SpA 1.125% Conv Sen 15/26.03.22	EUR	5.238.322,72	4,78	3,95
Cellnex Telecom SA 1.5% Conv EMTN Sen Reg S 18/16.01.26	EUR	4.875.464,71	4,45	3,67
Deutsche Wohnen SE 0.325% Conv Sen Reg S 17/26.07.24	EUR	4.864.406,37	4,44	3,66
SAFRAN SA 0% Conv Sen Reg S 18/21.06.23	EUR	4.627.388,25	4,22	3,49
LEG Immobilien AG 0.875% Sen Reg S Conv 17/01.09.25	EUR	4.065.025,20	3,71	3,06
Airbus SE 0% Conv DassAvia EMTN Reg S Sen 16/14.06.21	EUR	3.963.070,00	3,61	2,99
Orpea SA 0.375% Conv Sen Reg S 19/17.05.27	EUR	3.768.406,37	3,44	2,84
Iberdrola Intl BV 0% Conv Reg S Iberdrola SA 15/11.11.22	EUR	3.702.752,00	3,38	2,79
MTU Aero Engines AG 0.05% Conv Sen Reg S 19/18.03.27	EUR	3.374.059,14	3,08	2,54
Deutsche Wohnen SE 0.6% Conv Sen Reg S 17/05.01.26	EUR	2.862.302,73	2,61	2,16
Worldline SA 0% Conv Sen Reg S 19/30.07.26	EUR	2.786.155,50	2,54	2,10
Deutsche Post AG 0.05% Conv Sen Reg S 17/30.06.25	EUR	2.765.241,96	2,52	2,08
Adidas AG 0.05% Conv Sen Reg S 18/12.09.23	EUR	2.705.085,62	2,47	2,04
Edenred SA 0% Conv Sen Reg S 19/06.09.24	EUR	2.521.908,00	2,30	1,90
Fresenius SE & Co KGaA 0% Conv 17/31.01.24	EUR	2.369.436,00	2,16	1,78
Archer Obligations SA 0% Conv Kering Ser KER Sen 17/31.03.23	EUR	2.228.107,50	2,03	1,68
Grand City Properties SA VAR Conv Reg S Ser F 16/02.03.22	EUR	2.138.019,56	1,95	1,61
Air France KLM 0.125% Conv Sen Reg S 19/25.03.26	EUR	2.081.583,00	1,90	1,57
RAG-Stiftung 0% EMTN Conv Evonik Indust AG Reg S 15/18.02.21	EUR	2.053.020,00	1,87	1,55
RAG-Stiftung 0% Conv EvoniInd Re Sen Reg S 17/16.03.23	EUR	1.869.588,00	1,71	1,41
ORPAR 0% Conv RemCoint Reg S 17/20.06.24	EUR	1.863.045,00	1,70	1,40
GN Store Nord Ltd 0% Conv Sen Reg S 19/21.05.24	EUR	1.729.631,00	1,58	1,30
Nexity 0.25% Conv Sen 18/02.03.25	EUR	1.636.481,25	1,49	1,23
Elis SA 0% Conv Ser Elis Sen Reg S 17/06.10.23	EUR	1.601.284,30	1,46	1,21
UBISOFT Entertainment SA 0% Conv UBI Sen Reg S 19/24.09.24	EUR	1.576.135,31	1,44	1,19
Atos SE 0% Conv Worldlin Sen Reg S 19/06.11.24	EUR	1.315.990,50	1,20	0,99
Prysmian SpA 0% Conv Reg S Ser PRYI 17/17.01.22	EUR	1.294.039,50	1,18	0,97
Cellnex Telecom SA 0.5% Conv EMTN 19/05.07.28	EUR	1.229.801,47	1,12	0,93
Silicon On Insulator Tec 0% Conv Soitec Sen Reg S 8/28.06.23	EUR	1.068.367,58	0,97	0,80
CA-Immobilien-Anlagen AG 0.75% Conv Sen 17/04.04.25	EUR	1.053.771,80	0,96	0,79
BE Semiconductor Industries NV 0.5% Conv Sen 17/06.12.24	EUR	915.552,00	0,84	0,69
Corestate Capital Holding SA 1.375% Conv Sen 17/28.11.22	EUR	867.914,89	0,79	0,65
Symrise AG 0.2375% Conv Sen Ser SY1G Reg S	EUR	841.024,34	0,77	0,63

Titel	Währung	Betrag (EUR)	Prozentualer Anteil	
			Nettovermögen	Vermögen insgesamt
17/20.06.24				
Almirall SA 0.25% Sen Conv 18/14.12.21	EUR	829.041,29	0,76	0,62
ENI SpA 0% EMTN Sen Conv 16/13.04.22	EUR	822.432,00	0,75	0,62
Citigroup Gl Mks Fd Lux SCA 0.5% Conv Ser TKA 16/04.08.23	EUR	790.450,11	0,72	0,60
TAG Immobilien AG 0.625% Conv Sen Reg S 17/01.09.22	EUR	756.641,47	0,69	0,57
Aroundtown SA Bearer	EUR	399.200,00	0,36	0,30
UBISOFT Entertainment SA	EUR	227.846,00	0,21	0,17
GESAMT	EUR	85.677.992,44	78,14	64,54
Total SA 0.5% Conv Ser FP 15/02.12.22	USD	2.273.759,09	2,07	1,71
Glencore Funding LLC 0% Conv EMTN Sen Reg S 18/27.03.25	USD	1.853.303,64	1,69	1,40
Qiagen NV 1% Conv Sen Reg S 18/13.11.24	USD	1.823.771,07	1,66	1,37
STMicroelectronics NV 0.25% Conv Ser B Sen Reg S 17/03.07.24	USD	1.531.328,05	1,40	1,15
Michelin SA 0% Conv Sen 17/10.01.22	USD	1.270.518,39	1,16	0,96
LVMH Moët Hennessy L Vuit SE 0% Conv Sen 16/16.02.21	USD	755.142,51	0,69	0,57
GESAMT	USD	9.507.822,75	8,67	7,16
Sika AG 0.15% Conv Sen Reg S 18/05.06.25	CHF	2.685.951,63	2,45	2,02
GESAMT	CHF	2.685.951,63	2,45	2,02
Remgro Jersey GBP Ltd 2.625% Conv MediIntl 16/22.03.21	GBP	1.421.776,26	1,30	1,07
GESAMT	GBP	1.421.776,26	1,30	1,07
GESAMT		99.293.543,08	90,56	74,79

AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE NACH WIRTSCHAFTSSEKTOR

Wirtschaftssektor	Prozentualer Anteil	
	Nettovermögen	Vermögen insgesamt
Immobilienverwaltung und -bau	16,98	14,04
Luftfahrt und Verteidigung	10,91	9,01
Sonstige Finanzdienste	9,33	7,70
Medizinische Infrastruktur	5,60	4,62
Mobile Telekommunikationsdienste	5,57	4,60
Integrierte Telekommunikationsdienste	4,78	3,95
Sonstige Sektoren	37,39	30,87
GESAMT	90,56	74,79

AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE NACH HERKUNFTSLAND

Land	Prozentualer Anteil	
	Nettovermögen	Vermögen insgesamt
FRANKREICH	28,81	23,81
DEUTSCHLAND	26,02	21,49
NIEDERLANDE	10,89	8,99
Sonstige Länder	24,84	20,50
GESAMT	90,56	74,79

VERÄNDERUNG DES WERTPAPIERBESTANDS IM BERICHTSZEITRAUM

Bestandteile des Wertpapierportfolios	Veränderungen (Betrag)	
	Käufe	Verkäufe
a) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gemäß Artikel L. 422-1 des Code Monétaire et Financier gehandelt werden	20.289.272,60	31.015.809,22
b) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt gehandelt werden, der sich in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder einem anderen Staat befindet, der dem Europäischen Wirtschaftsraum angehört	0,00	0,00
c) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittstaats zugelassen sind oder an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt eines Drittstaats gehandelt werden, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf einer von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde veröffentlichten Liste steht oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Markts per Gesetz oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,00	119.701,80
d) In Artikel R. 214-11, Abschnitt I, Absatz 4 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) aufgeführte neu emittierte Finanztitel	0,00	0,00
e) Sonstige Vermögenswerte: Es handelt sich um die in Artikel R. 214-11, Abschnitt II des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) aufgeführten Vermögenswerte	10.332.167,50	16.746.148,50

Veränderungen im Berichtszeitraum	Veränderungen (Betrag)
Käufe	30.621.440,10
Verkäufe	47.881.659,52

AUSSCHÜTTUNGEN IM BERICHTSZEITRAUM

Entfällt

	Anteil EUR	Nettobetrag pro Einheit EUR	Steuergutschrift EUR	Bruttobetrag pro Einheit EUR
Ausschüttung auf das Ergebnis				
Gezahlt				
Zahlbar				
	D1 DI-EUR-ANTEIL			
Ausschüttung auf die Gewinne oder Verluste				
Gezahlt				
Zahlbar				
	D1 DI-EUR-ANTEIL			

BESTANDSVERZEICHNIS

Wertpapierbezeichnung	Wahrung	Menge Anzahl oder Nennwert	Borsenwert	% des Nettovermogens
Aroundtown SA Bearer	EUR	50.000	399.200,00	0,36
UBISOFT Entertainment SA	EUR	3.700	227.846,00	0,21
GESAMT An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelte Aktien und ahnliche Wertpapiere (auer Warrants und Bezugsscheine)			627.046,00	0,57
GESAMT An einem geregelten Markt gehandelte Aktien und ahnliche Wertpapiere			627.046,00	0,57
GESAMT Aktien & ahnliche Wertpapiere			627.046,00	0,57
Airbus SE 0% Conv DassAvia EMTN Reg S Sen 16/14.06.21	EUR	3.700.000	3.963.070,00	3,61
Prysmian SpA 0% Conv Reg S Ser PRYI 17/17.01.22	EUR	1.300.000	1.294.039,50	1,18
Archer Obligations SA 0% Conv Kering Ser KER Sen 17/31.03.23	EUR	1.500.000	2.228.107,50	2,03
Deutsche Wohnen SE 0.6% Conv Sen Reg S 17/05.01.26	EUR	2.700.000	2.862.302,73	2,61
RAG-Stiftung 0% Conv EvonilInd Re Sen Reg S 18/02.10.24	EUR	1.300.000	1.332.103,50	1,21
Almirall SA 0.25% Sen Conv 18/14.12.21	EUR	800.000	829.041,29	0,76
Orpea SA 0.375% Conv Sen Reg S 19/17.05.27	EUR	23.177	3.768.406,37	3,44
Edenred SA 0% Conv Sen Reg S 19/06.09.24	EUR	38.000	2.521.908,00	2,30
UBISOFT Entertainment SA 0% Conv UBI Sen Reg S 19/24.09.24	EUR	13.125	1.576.135,31	1,44
RAG-Stiftung 0% EMTN Conv Evonik Indust AG Reg S 15/18.02.21	EUR	2.000.000	2.053.020,00	1,87
Telecom Italia SpA 1.125% Conv Sen 15/26.03.22	EUR	5.200.000	5.238.322,72	4,76
Iberdrola Intl BV 0% Conv Reg S Iberdrola SA 15/11.11.22	EUR	3.200.000	3.702.752,00	3,38
Total SA 0.5% Conv Ser FP 15/02.12.22	USD	2.400.000	2.273.759,09	2,07
LVMH Moet Hennessy L Vuit SE 0% Conv Sen 16/16.02.21	USD	1.700	755.142,51	0,69
Grand City Properties SA VAR Conv Reg S Ser F 16/02.03.22	EUR	2.000.000	2.138.019,56	1,95
Remgro Jersey GBP Ltd 2.625% Conv MediIntl 16/22.03.21	GBP	1.200.000	1.421.776,26	1,30
Citigroup Gl Mks Fd Lux SCA 0.5% Conv Ser TKA 16/04.08.23	EUR	700.000	790.450,11	0,72
Michelin SA 0% Conv Sen 17/10.01.22	USD	1.400.000	1.270.518,39	1,16
Fresenius SE & Co KGaA 0% Conv 17/31.01.24	EUR	2.400.000	2.369.436,00	2,16
Deutsche Wohnen SE 0.325% Conv Sen Reg S 17/26.07.24	EUR	4.600.000	4.864.406,37	4,44
RAG-Stiftung 0% Conv EvonilInd Re Sen Reg S 17/16.03.23	EUR	1.800.000	1.869.588,00	1,71
Symrise AG 0.2375% Conv Sen Ser SY1G Reg S 17/20.06.24	EUR	700.000	841.024,34	0,77
ORPAR 0% Conv RemCoint Reg S 17/20.06.24	EUR	1.800.000	1.863.045,00	1,70
STMicroelectronics NV 0.25% Conv Ser B Sen Reg S 17/03.07.24	USD	1.200.000	1.531.328,05	1,40
TAG Immobilien AG 0.625% Conv Sen Reg S 17/01.09.22	EUR	600.000	756.641,47	0,69
LEG Immobilien AG 0.875% Sen Reg S Conv 17/01.09.25	EUR	3.500.000	4.065.025,20	3,71
CA-Immobilien-Anlagen AG 0.75% Conv Sen 17/04.04.25	EUR	800.000	1.053.771,80	0,96
Elis SA 0% Conv Ser Elis Sen Reg S 17/06.10.23	EUR	49.700	1.601.284,30	1,46
Corestate Capital Holding SA 1.375% Conv Sen 17/28.11.22	EUR	1.000.000	867.914,89	0,79
BE Semiconductor Industries NV 0.5% Conv Sen 17/06.12.24	EUR	900.000	915.552,00	0,84
Deutsche Post AG 0.05% Conv Sen Reg S 17/30.06.25	EUR	2.700.000	2.765.241,96	2,52
Cellnex Telecom SA 1.5% Conv EMTN Sen Reg S 18/16.01.26	EUR	3.600.000	4.875.464,71	4,45
Nexity 0.25% Conv Sen 18/02.03.25	EUR	23.500	1.636.481,25	1,49
Glencore Funding LLC 0% Conv EMTN Sen Reg S 18/27.03.25	USD	2.400.000	1.853.303,64	1,69
Sika AG 0.15% Conv Sen Reg S 18/05.06.25	CHF	2.500.000	2.685.951,63	2,45
SAFRAN SA 0% Conv Sen Reg S 18/21.06.23	EUR	28.500	4.627.388,25	4,22
Silicon On Insulator Tec 0% Conv Soitec Sen Reg S 8/28.06.23	EUR	8.850	1.068.367,58	0,97
Adidas AG 0.05% Conv Sen Reg S 18/12.09.23	EUR	2.200.000	2.705.085,62	2,47
Qiagen NV 1% Conv Sen Reg S 18/13.11.24	USD	2.000.000	1.823.771,07	1,66

In Form einer Vereinfachten Aktiengesellschaft franzosischen Rechts („Societe Anonyme Simplifiee“) errichtete Portfolioverwaltungsgesellschaft mit einem Kapital von 7.500.000 EUR.

Zugelassen von der franzosischen Finanzmarktaufsichtsbehorde („Autorite des Marches Financiers“) unter der Nr. GP 99011 – RCS 340 902 857 Paris

12, boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Frankreich

Tel.: 33 (0)1 44 51 85 00 – www.am.oddo-bhf.com

Wertpapierbezeichnung	Währung	Menge Anzahl oder Nennwert	Börsenwert	% des Nettovermögens
Air France KLM 0.125% Conv Sen Reg S 19/25.03.26	EUR	114.000	2.081.583,00	1,90
GN Store Nord Ltd 0% Conv Sen Reg S 19/21.05.24	EUR	1.700.000	1.729.631,00	1,58
Cellnex Telecom SA 0.5% Conv EMTN 19/05.07.28	EUR	1.100.000	1.229.801,47	1,12
Worldline SA 0% Conv Sen Reg S 19/30.07.26	EUR	25.500	2.786.155,50	2,54
MTU Aero Engines AG 0.05% Conv Sen Reg S 19/18.03.27	EUR	3.100.000	3.374.059,14	3,08
Atos SE 0% Conv Worldlin Sen Reg S 19/06.11.24	EUR	1.100.000	1.315.990,50	1,20
GESAMT An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere			99.176.168,58	90,45
GESAMT Anleihen & ähnliche Wertpapiere			99.176.168,58	90,45
ENI SpA 0% EMTN Sen Conv 16/13.04.22	EUR	800.000	822.432,00	0,75
GESAMT Sonstige Schuldtitel			822.432,00	0,75
GESAMT Sonstige Schuldtitel			822.432,00	0,75
GESAMT Schuldtitel			822.432,00	0,75
Oddo BHF Jour CI EUR Cap	EUR	2.000	4.746.980,00	4,33
GESAMT allgemeine OGAW und AIF			4.746.980,00	4,33
GESAMT Nicht professionellen Kunden vorbehaltene allgemeine Investmentfonds und vergleichbare Produkte aus anderen Mitgliedstaaten der EU			4.746.980,00	4,33
GESAMT OGA-Anteile			4.746.980,00	4,33
DE000A2GSDH2 130920	EUR	1.631.000	611,63	0,00
DE000A2GSDH2 250920	EUR	1.153.200	600,63	0,00
XS1209185161 301020	EUR	909.000	189,38	0,00
FR0013418795 071120	EUR	503.279,2	262,12	0,00
XS1321004118 131220	EUR	1.596.000	399,00	0,00
DE000A2LQRW5 231220	EUR	1.729.000	319,38	0,00
FR0013457942 241220	EUR	839.790	67,65	0,00
GESAMT Befristete Wertpapiergeschäfte			2.449,79	0,00
GESAMT Befristete Wertpapiergeschäfte			2.449,79	0,00
GESAMT Forderungen aus verliehenen Wertpapieren			2.449,79	0,00
XS1321004118 281120	EUR	-230.000	-229.778,95	-0,21
XS1321004118 101220	EUR	-338.010	-337.806,68	-0,31
GESAMT Befristete Wertpapiergeschäfte			-567.585,63	-0,52
GESAMT Befristete Wertpapiergeschäfte			-567.585,63	-0,52
GESAMT Verbindlichkeiten aus in Pension gegebenen Wertpapieren			-567.585,63	-0,52
GESAMT Befristete Wertpapiergeschäfte			-565.135,84	-0,52
VDPW/1221/CALL/32.	EUR	246	93.726,00	0,09
GESAMT Optionen – Transaktionen an geregelten oder ähnlichen Märkten			93.726,00	0,09
GESAMT Optionen			93.726,00	0,09
GESAMT Terminkontrakte			93.726,00	0,09
STMicroelectronics NV 0.25% Conv Ser B Sen Reg S 17/03.07.24	USD	6	1.336,06	0,00
GESAMT Kupons und Dividenden			1.336,06	0,00
CPTN EONIA 0.00 1309	EUR	-1.712.550	-1.711.898,04	-1,56
CPTN EONIA 0.00 2509	EUR	-1.210.860	-1.210.399,03	-1,10
CPTN EONIA 0.00 3010	EUR	-954.450	-954.086,65	-0,87
CPTN EONIA 0.00 0711	EUR	-528.443,16	-528.241,98	-0,48
CPTN EONIA 0.00 1312	EUR	-1.675.800	-1.675.480,53	-1,53
CPTN EONIA 0.00 2312	EUR	-1.815.450	-1.815.287,67	-1,66
CPTN EONIA 0.00 2412	EUR	-881.779,5	-881.734,75	-0,80

In Form einer Vereinfachten Aktiengesellschaft französischen Rechts („Société Anonyme Simplifiée“) errichtete Portfolioverwaltungsgesellschaft mit einem Kapital von 7.500.000 EUR.

Zugelassen von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde („Autorité des Marchés Financiers“) unter der Nr. GP 99011 – RCS 340 902 857 Paris

12, boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Frankreich

Tel.: 33 (0)1 44 51 85 00 – www.am.oddo-bhf.com

Wertpapierbezeichnung	Währung	Menge Anzahl oder Nennwert	Börsenwert	% des Nettovermögens
GESAMT Ersteinschuss			-8.777.128,65	-8,00
Diverse Kreditoren Z/R EUR	EUR	-31.362,92	-31.362,92	-0,03
Diverse Debitoren Z/R EUR	EUR	2.555,88	2.555,88	0,00
GESAMT Sonstige Verbindlichkeiten und Forderungen			-28.807,04	-0,03
GESAMT Verbindlichkeiten und Forderungen			-8.804.599,63	-8,03
OddoCie CHF	CHF	1.785,54	1.643,48	0,00
OddoCie EUR	EUR	4.859.000,09	4.859.000,09	4,44
OddoCie GBP	GBP	1.669,67	1.970,38	0,00
OddoCie USD	USD	706,25	629,06	0,00
OddoCie EUR	EUR	1.328,53	1.328,53	0,00
GESAMT Vermögenswerte			4.864.571,54	4,44
V/A CHF EUR 150120	EUR	2.630.883,01	2.630.883,01	2,40
V/A CHF EUR 150120	CHF	-2.885.000	-2.655.949,17	-2,42
V/A USD EUR 150120	EUR	9.615.367,39	9.615.367,39	8,77
V/A USD EUR 150120	USD	-10.732.000	-9.551.463,86	-8,71
V/A GBP EUR 150120	EUR	1.415.373,74	1.415.373,74	1,29
V/A GBP EUR 150120	GBP	-1.200.000	-1.415.532,42	-1,29
GESAMT Termingeschäfte			38.678,69	0,04
TERM FIX 0.01 181220	EUR	2.000.000	2.000.007,22	1,82
TERM FIX 0.00 020120	EUR	6.758.538,71	6.758.538,71	6,16
GESAMT Termineinlagen			8.758.545,93	7,98
GESAMT Liquide Mittel			13.661.796,16	12,46
Verwaltungsgebühr	EUR	-112.718,39	-112.718,39	-0,10
GESAMT Kosten			-112.718,39	-0,10
GESAMT Kosten			-112.718,39	-0,10
GESAMT Kosten			-112.718,39	-0,10
GESAMT BARMITTEL			4.744.478,14	4,33
GESAMT NETTOVERMÖGEN			109.645.694,88	100,00

ODDO BHF EUROPEAN CONVERTIBLES

Securities Financing Transactions Regulation

31.12.2019

EUR

In Form einer Vereinfachten Aktiengesellschaft französischen Rechts („Société Anonyme Simplifiée“) errichtete Portfolioverwaltungsgesellschaft mit einem Kapital von 7.500.000 EUR.

Zugelassen von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde („Autorité des Marchés Financiers“) unter der Nr. GP 99011 – RCS 340 902 857 Paris

12, boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Frankreich

Tel.: 33 (0)1 44 51 85 00 – www.am.oddo-bhf.com

Betrag der Vermögenswerte, die bei den einzelnen Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps eingesetzt worden sind, ausgedrückt als absoluter Betrag und in Prozent des Nettogesamtvermögens

	Verliehene Wertpapiere	Entliehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
Summe			578.555,00		
% des Nettogesamtvermögens			0,53%		

Betrag der verliehenen Wertpapiere und Waren, ausgedrückt als Anteil an den Vermögenswerten

	Verliehene Wertpapiere	Entliehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
Betrag der verliehenen Vermögenswerte	8.383.439,70				
% der verliehbaren Vermögenswerte	8,38%				

Die zehn wichtigsten Emittenten von erhaltenen Sicherheiten (ohne liquide Mittel) für alle Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (aufgeschlüsselt nach Volumen der Sicherheiten für laufende Vereinbarungen)

1. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
2. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
3. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
4. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
5. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
6. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
7. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
8. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
9. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
10. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	

In Form einer Vereinfachten Aktiengesellschaft französischen Rechts („Société Anonyme Simplifiée“) errichtete Portfolioverwaltungsgesellschaft mit einem Kapital von 7.500.000 EUR.

Zugelassen von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde („Autorité des Marchés Financiers“) unter der Nr. GP 99011 – RCS 340 902 857 Paris

12, boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Frankreich

Tel.: 33 (0)1 44 51 85 00 – www.am.oddo-bhf.com

Die zehn wichtigsten Gegenparteien als absoluter Wert der Aktiva und Passiva ohne Clearing

	Verleihte Wertpapiere	Entlehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
1. Name	ODDO		ODDO		
Summe	8.383.439,70		578.555,00		
Sitz	PARIS		PARIS		
2. Name					
Summe					
Sitz					
3. Name					
Summe					
Sitz					
4. Name					
Summe					
Sitz					
5. Name					
Summe					
Sitz					
6. Name					
Summe					
Sitz					
7. Name					
Summe					
Sitz					
8. Name					
Summe					
Sitz					
9. Name					
Summe					
Sitz					
10. Name					
Summe					
Sitz					

In Form einer Vereinfachten Aktiengesellschaft französischen Rechts („Société Anonyme Simplifiée“) errichtete Portfolioverwaltungsgesellschaft mit einem Kapital von 7.500.000 EUR.

Zugelassen von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde („Autorité des Marchés Financiers“) unter der Nr. GP 99011 – RCS 340 902 857 Paris

12, boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Frankreich

Tel.: 33 (0)1 44 51 85 00 – www.am.oddo-bhf.com

Art und Qualität der Sicherheiten

	Verliehene Wertpapiere	Entliehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
Art und Qualität der Sicherheit					
Liquide Mittel	8.777.128,65		567.585,63		
Schuldinstrumente					
Hohes Rating					
Mittleres Rating					
Niedriges Rating					
Aktien					
Hohes Rating					
Mittleres Rating					
Niedriges Rating					
Fondsanteile					
Hohes Rating					
Mittleres Rating					
Niedriges Rating					
Währung der Sicherheit					
Land des Emittenten der Sicherheit					

Laufzeit der Sicherheiten, aufgeschlüsselt nach den folgenden Zeitspannen:

	Verliehene Wertpapiere	Entliehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
weniger als 1 Tag					
1 Tag bis 1 Woche					
1 Woche bis 1 Monat					
1 bis 3 Monate					
3 Monate bis 1 Jahr					
mehr als 1 Jahr					
offen					

Laufzeit der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps, aufgeschlüsselt nach den folgenden Zeitspannen:

	Verliehene Wertpapiere	Entlehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
weniger als 1 Tag					
1 Tag bis 1 Woche					
1 Woche bis 1 Monat					
1 bis 3 Monate					
3 Monate bis 1 Jahr					
mehr als 1 Jahr					
offen	8.383.439,70		578.555,00		

Abwicklung und Clearing von Kontrakten

	Verliehene Wertpapiere	Entlehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
Zentrale Gegenpartei					
Bilateral					
Trilateral					

Daten zur Weiterverwendung der Sicherheiten

	Barsicherheiten	Titel
Höchstbetrag (%)		
Verwendeter Betrag (%)		
Rendite des OGA aus der Wiederanlage der Barsicherheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps		

Daten zur Verwahrung der dem OGA bereitgestellten Sicherheiten

1. Name	ODDO
Verwahrter Betrag	9.344.714,28

Daten zur Verwahrung der vom OGA gestellten Sicherheiten

Gesamtbetrag der gestellten Sicherheiten

In % aller gestellten Sicherheiten

Getrennte Konten
 Zusammengefasste Konten
 Sonstige Konten

Aufschlüsselung der Renditen

	Verliehene Wertpapiere	Entliehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
OGA					
Summe	28.721,50		13.865,87		
in % der Rendite	12,30%		5,94%		
Fondsmanager					
Summe					
in % der Rendite					
Dritte (z.B. Leihstelle)					
Summe					
in % der Rendite					

Aufschlüsselung der Kosten

	Verliehene Wertpapiere	Entliehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
OGA	337,45				
Summe					
Fondsmanager					
Summe					
Dritte (z.B. Leihstelle)					
Summe					