



ODDO BHF
ASSET MANAGEMENT

Rapport semestriel

ODDO BHF Green Bond

31 mars 2026

Synthèse du patrimoine au 31/03/2026

Priorités d'investissement	Valeur actuelle en EUR	en % des actifs du Fonds
I. Actifs	102.150.737,73	100,10
1. Obligations	96.146.016,61	94,22
≥ 1 an à < 3 ans	10.797.044,34	10,58
≥ 3 ans à < 5 ans	13.219.761,63	12,95
≥ 5 ans à < 10 ans	44.877.050,42	43,98
≥ 10 ans	27.252.160,22	26,71
2. Instruments dérivés	6.822,68	0,01
3. Avoirs bancaires	4.507.492,76	4,42
4. Autres actifs	1.490.405,68	1,46
II. Dettes	-104.113,34	-0,10
III. Actifs du Fonds	102.046.624,39	100,00

État du patrimoine au 31/03/2026

Code ISIN	Unités, Parts ou Devise en milliers	Quantité 31/03/2026	Achats/ entrées sur la période	Ventes/ sorties sous revue	Cours	Valeur de marché en EUR	en % des actifs du Fonds
TITRES NÉGOCIÉS EN BOURSE						89.944.312,20	88,14
Obligations						89.944.312,20	88,14
5,0000 % A2A S.p.A. EO-FLR Nts 24(24/Und.) XS2830327446	EUR	1.100	1.100	0	100,883 %	1.109.708,56	1,09
4,0000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 23(28) XS2575971994	EUR	200	0	0	101,252 %	202.503,40	0,20
3,9000 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-T. Notes 23(33) ES0200002089	EUR	700	0	0	102,526 %	717.682,00	0,70
3,5000 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 24(32) ES0200002121	EUR	800	0	0	100,327 %	802.616,00	0,79
3,1250 % Adif - Alta Velocidad EO-Medium-Term Notes 25(32) ES0200002154	EUR	1.000	0	0	97,596 %	975.960,00	0,96
4,5000 % Allianz N.V. EO-FLR Securit. 24(32/Und.) XS2829852842	EUR	300	300	0	100,089 %	300.267,00	0,29
1,3750 % AXA S.A. EO-FLR M.-T.Nts 21(31/41) XS2314312179	EUR	800	800	0	87,888 %	703.105,60	0,69
1,2500 % Royaume de Belgique EO-Obl. Lin. 18(33) Ser. 86 BE0000346552	EUR	2.200	500	300	87,786 %	1.931.281,00	1,89
4,2500 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 23(30/31) FR001400H9B5	EUR	1.200	600	0	101,836 %	1.222.026,00	1,20
1,7500 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.22(32) FR001400AJW4	EUR	1.900	0	0	91,310 %	1.734.880,50	1,70
3,2500 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.25(35) FR0014010MT8	EUR	1.200	500	0	97,540 %	1.170.480,00	1,15
3,3750 % Bpifrance SACA EO-Med.-T. Notes 26(36) FR0014016JF0	EUR	800	800	0	95,873 %	766.985,60	0,75
3,5000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred Med.-T.Nts 24(31) FR001400Q0T5	EUR	1.500	700	0	99,292 %	1.489.380,00	1,46
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.20 (30) DE0001030708	EUR	61	0	500	89,163 %	54.272,88	0,05
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.21 (50) Grüne DE0001030724	EUR	4.600	4.600	300	44,094 %	2.028.319,40	1,99
2,3000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.23 (33) Grüne DE000BU3Z005	EUR	2.200	600	4.200	96,643 %	2.126.135,00	2,08
5,2500 % Commerzbank AG FLR-MTN Serie 1018 v.23(28/29) DE000CZ439B6	EUR	600	0	600	103,411 %	620.468,40	0,61
3,6250 % Commerzbank AG FLR-MTN Serie 1061 v.25(31/32) DE000CZ45ZA0	EUR	1.500	400	0	99,041 %	1.485.613,50	1,46
4,0000 % Commerzbank AG Sub.Fix to Reset MTN 26(33/38) DE000CZ457W4	EUR	200	400	200	96,890 %	193.780,60	0,19
4,6250 % Covivio S.A. EO-Med.-T. Nts 23(23/32) FR001400MDV4	EUR	700	300	0	102,041 %	714.289,80	0,70

SUIITE : État du patrimoine au 31 mars 2026

Code ISIN	Unités, Parts ou Devise en milliers	Quantité 31/03/2026	Achats/ entrées sur la période	Ventes/ sorties sous revue	Cours	Valeur de marché en EUR	en % des actifs du Fonds
TITRES NÉGOCIÉS EN BOURSE (SUIITE)							
Obligations							
0,0500 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.19(29) FR0013465010	EUR	1.100	1.000	0	89,713 %	986.844,10	0,97
3,0000 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.25(33) FR0014012BB5	EUR	500	0	0	97,799 %	488.996,00	0,48
3,2500 % Crédit Agricole S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 25(31/32) FR0014012AJ0	EUR	1.400	0	0	97,076 %	1.359.059,80	1,33
3,5000 % Crédit Agricole S.A. EO-Med.-Term Notes 24(34) FR001400SVC3	EUR	100	500	400	96,223 %	96.223,20	0,09
3,3750 % Danske Bank AS EO-FLR Med.-Term Nts 25(32/33) XS3244187764	EUR	451	851	400	96,894 %	436.992,39	0,43
3,2500 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.22(27/28) DE000DL19WU8	EUR	1.100	0	0	99,986 %	1.099.850,40	1,08
3,7500 % DNB Bank ASA EO-FLR Med.-T. Nts 25(30/35) XS3038553353	EUR	300	300	600	98,788 %	296.364,00	0,29
4,5000 % DNB Bank ASA EO-FLR Med.-Term Nts 23(27/28) XS2652069480	EUR	900	0	0	101,722 %	915.495,30	0,90
3,0000 % DNB Bank ASA EO-FLR Non-Pref. MTN 24(29/30) XS2950722616	EUR	600	0	200	98,264 %	589.586,40	0,58
3,8950 % E.ON SE EO-Med. Term Nts v.26(37/38) XS3274805459	EUR	832	832	0	97,758 %	813.347,39	0,80
3,2500 % EDP Servicios Financ.Espana SA EO-Medium-Term Nts 26(26/32) XS3286252963	EUR	305	305	0	97,656 %	297.850,19	0,29
3,1250 % Eika BoligKreditt A.S. EO-Med.-Term Cov. Bds 26(34) XS3324588410	EUR	500	500	0	98,762 %	493.811,00	0,48
4,1250 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 24(24/31) FR001400QR62	EUR	400	0	400	102,248 %	408.992,00	0,40
4,5000 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 26(26/46) FR0014016LZ4	EUR	400	400	0	95,238 %	380.950,80	0,37
3,2790 % Eurogrid GmbH MTN v.22(22/31) XS2527319979	EUR	600	300	0	97,894 %	587.364,00	0,58
4,1650 % Eurogrid GmbH MTN v.25(25/40) XS3201905091	EUR	300	500	200	96,124 %	288.370,80	0,28
0,4000 % Union européenne EO-Medium-Term Notes 21(37) EU000A3K4C42	EUR	100	0	1.900	72,472 %	72.472,00	0,07
2,7500 % Union européenne EO-Med.-T. Nts 22(33) EU000A3K4DW8	EUR	2.100	0	0	97,591 %	2.049.419,40	2,01
1,2500 % Union européenne EO-Med.-T. Nts 22(43) EU000A3K4DG1	EUR	2.000	0	1.820	67,691 %	1.353.822,00	1,33
2,6250 % Union européenne EO-Med.-T. Nts 22(48) EU000A3K4DM9	EUR	2.700	500	800	79,961 %	2.158.947,00	2,12

SUIITE : État du patrimoine au 31 mars 2026

Code ISIN	Unités, Parts ou Devise en milliers	Quantité 31/03/2026	Achats/ entrées sur la période	Ventes/ sorties sous revue	Cours	Valeur de marché en EUR	en % des actifs du Fonds
TITRES NÉGOCIÉS EN BOURSE (SUIITE)							
Obligations							
3,2500 % Union européenne EO-Med.-T. Nts 24(50) EU000A3K4EU0	EUR	600	0	0	87,848 %	527.090,40	0,52
1,5000 % European Investment Bank EO-Medium-T. Notes 17(47) XS1641457277	EUR	100	0	0	67,315 %	67.314,50	0,07
1,0000 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 19(42) XS1980857319	EUR	100	0	0	67,205 %	67.205,20	0,07
0,0100 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 20(35) XS2194790262	EUR	400	0	0	73,396 %	293.585,60	0,29
1,5000 % European Investment Bank EO-Medium-Term Notes 22(32) XS2484093393	EUR	100	0	200	91,484 %	91.484,10	0,09
1,7500 % France EO-OAT 17(39) FR0013234333	EUR	1.000	1.800	2.300	77,258 %	772.584,00	0,76
3,0000 % France EO-OAT 23(49) FR001400NEF3	EUR	2.300	900	0	80,869 %	1.859.987,00	1,82
3,5470 % Generali S.p.A. EO-Med.-T. Nts 24(24/34) XS2747596315	EUR	1.500	1.500	400	98,309 %	1.474.636,50	1,45
2,9000 % Hessen, Land Schatzanw. S.2503 v.25(35) DE000A1RQE59	EUR	1.121	0	0	96,993 %	1.087.287,05	1,07
4,8750 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-FLR M.-T. Nts 23(23/Und.) XS2580221658	EUR	1.100	0	0	101,908 %	1.120.988,00	1,10
4,2470 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-FLR M.-T. Nts 24(24/Und.) XS2949317676	EUR	100	0	0	99,674 %	99.673,80	0,10
3,7500 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-FLR M.-T. Nts 25(25/Und.) XS3224600232	EUR	100	400	300	96,692 %	96.691,80	0,09
0,9500 % Ile-de-France Mobilités EO-Medium-Term Notes 22(32) FR0014008CQ9	EUR	900	0	0	86,949 %	782.541,00	0,77
4,0000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 24(34/35) XS2764264789	EUR	100	0	0	99,778 %	99.778,00	0,10
2,8750 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 25(29/30) XS3225326282	EUR	600	600	0	97,585 %	585.508,20	0,57
3,1250 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 26(31/32) XS3291116955	EUR	300	300	0	97,104 %	291.312,60	0,29
0,8750 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 21(27/32) XS2350756446	EUR	1.400	800	0	97,313 %	1.362.375,70	1,34
4,1250 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.T.Nts 25(31/36) XS3074495444	EUR	200	0	200	99,765 %	199.530,40	0,20
0,0100 % ING DiBa AG Hyp.-Pfandbrief v.21(28) DE000A1KRJV6	EUR	600	0	0	93,023 %	558.137,40	0,55
3,8750 % Iren S.p.A. EO-Medium-T. Nts 24(24/32) XS2752472436	EUR	900	900	0	100,623 %	905.609,70	0,89

SUIITE : État du patrimoine au 31 mars 2026

Code ISIN	Unités, Parts ou Devise en milliers	Quantité 31/03/2026	Achats/ entrées sur la période	Ventes/ sorties sous revue	Cours	Valeur de marché en EUR	en % des actifs du Fonds
TITRES NÉGOCIÉS EN BOURSE (SUIITE)							
Obligations							
3,0000 % Irlande EO-Treasury Bonds 23(43) IE000GVLBXU6	EUR	1.500	1.500	100	92,657 %	1.389.850,50	1,36
4,0000 % République d'Italie EO-B.T.P. 22(35) IT0005508590	EUR	2.000	600	1.600	101,545 %	2.030.892,00	1,99
4,0000 % République d'Italie EO-B.T.P. 23(31) IT0005542359	EUR	3.400	0	3.200	103,428 %	3.516.541,80	3,45
4,1000 % République d'Italie EO-B.T.P. 25(46) IT0005631608	EUR	1.100	0	300	96,081 %	1.056.887,70	1,04
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.21(29) XS2331327564	EUR	100	0	0	91,528 %	91.528,10	0,09
1,9000 % Landwirtschaftliche Rentenbank Med.T.Nts. Ser.1222 v.22(32) XS2500341990	EUR	1.800	0	0	93,562 %	1.684.123,20	1,65
0,0000 % Landwirtschaftliche Rentenbank Med.T.Nts.v.21(31) XS2359292955	EUR	2.500	0	0	85,671 %	2.141.762,50	2,10
1,2500 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.1989 v.22(30) DE000MHB30J1	EUR	1.029	0	0	93,886 %	966.082,82	0,95
3,5630 % National Grid Electr.Trans.PLC EO-Medium Term Nts 26(26/34) XS3286502821	EUR	376	376	0	97,514 %	366.650,76	0,36
0,2500 % National Grid PLC EO-Medium Term Nts 21(21/28) XS2381853279	EUR	368	0	0	93,116 %	342.667,98	0,34
3,6730 % NatWest Group PLC EO-FLR Med.-T.Nts 24(30/31) XS2871577115	EUR	100	0	0	99,988 %	99.988,00	0,10
0,5000 % Pays-Bas EO-Anl. 19(40) NL0013552060	EUR	4.100	3.100	1.000	68,986 %	2.828.442,40	2,77
6,0000 % NN Group N.V. EO-FLR Med.-T.Nts 23(23/43) XS2616652637	EUR	100	0	700	109,296 %	109.295,70	0,11
1,5000 % Orsted A/S EO-Med.-T. Notes 17(17/29) XS1721760541	EUR	400	0	0	92,616 %	370.464,00	0,36
2,2500 % Orsted A/S EO-Med.-Term Nts 22(22/28) XS2490471807	EUR	300	0	0	97,702 %	293.106,90	0,29
3,2500 % Orsted A/S EO-Med.-Term Nts 22(22/31) XS2531569965	EUR	100	0	200	97,265 %	97.265,10	0,10
3,7500 % Orsted A/S EO-Med.-Term Nts 23(23/30) XS2591029876	EUR	700	0	200	100,197 %	701.378,30	0,69
1,8500 % République d'Autriche EO-Medium-Term Notes 22(49) AT0000A2Y8G4	EUR	1.100	600	0	70,892 %	779.808,70	0,76
2,9000 % République d'Autriche EO-Medium-Term Notes 23(29) AT0000A33SH3	EUR	2.200	1.700	1.000	100,389 %	2.208.547,00	2,16
3,3750 % Scot.Hydro-Electric Trans.PLC EO-Med.-Term Notes 25(25/33) XS3166372568	EUR	1.200	0	0	96,812 %	1.161.744,00	1,14
4,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 23(28) XS2713671043	EUR	300	0	0	102,568 %	307.704,60	0,30

SUIITE : État du patrimoine au 31 mars 2026

Code ISIN	Unités, Parts ou Devise en milliers	Quantité 31/03/2026	Achats/ entrées sur la période	Ventes/ sorties sous revue	Cours	Valeur de marché en EUR	en % des actifs du Fonds
TITRES NÉGOCIÉS EN BOURSE (SUIITE)							
Obligations							
3,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 25(30) XS3029220392	EUR	324	0	0	99,496 %	322.367,36	0,32
1,7000 % Société des Grands Projets EO-Medium-Term Notes 19(50) FR0013422383	EUR	100	0	400	60,114 %	60.114,40	0,06
0,0000 % Société des Grands Projets EO-Medium-Term Notes 20(30) FR00140005B8	EUR	900	800	0	86,271 %	776.439,00	0,76
3,5000 % Société des Grands Projets EO-Medium-Term Notes 23(43) FR001400F6X7	EUR	1.000	0	400	90,251 %	902.506,00	0,88
3,5000 % Société des Grands Projets EO-Medium-Term Notes 24(49) FR001400NUQ6	EUR	200	0	200	86,615 %	173.230,20	0,17
3,6250 % Société Générale S.A. EO-FLR N-Pf.MTN 24(29/30) FR001400U1Q3	EUR	1.600	300	0	99,583 %	1.593.331,20	1,56
0,8750 % Société Générale S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 20(27/28) FR0013536661	EUR	600	0	0	96,491 %	578.946,60	0,57
1,0000 % Espagne EO-Bonos 21(42) ES0000012J07	EUR	3.000	0	2.000	65,353 %	1.960.590,00	1,92
2,7500 % SR-Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 26(33) XS3305169255	EUR	500	500	0	97,294 %	486.471,00	0,48
2,8750 % SSE PLC EO-Med.-T. Notes 22(22/29) XS2510903862	EUR	741	0	300	98,755 %	731.773,07	0,72
3,7170 % Standard Chartered PLC EO-FLR Med.-T. Nts 26(33/34) XS3258445660	EUR	600	600	0	97,329 %	583.974,00	0,57
2,8750 % Statkraft AS EO-Med.-T. Nts 22(22/29) XS2532312548	EUR	600	0	400	98,709 %	592.251,60	0,58
3,5000 % Statnett SF EO-Med.-T. Notes 23(23/33) XS2631835332	EUR	300	500	300	99,351 %	298.052,10	0,29
4,6250 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 24(24/Und.) XS2783604742	EUR	400	0	400	101,077 %	404.306,68	0,40
3,8750 % TenneT Netherlands B.V. EO-Med.-Term Notes 22(22/28) XS2549543143	EUR	310	0	0	101,848 %	315.727,25	0,31
4,2500 % TenneT Netherlands B.V. EO-Med.-Term Notes 22(22/32) XS2549543226	EUR	800	600	500	104,299 %	834.394,40	0,82
4,7500 % TenneT Netherlands B.V. EO-Med.-Term Notes 22(22/42) XS2549715618	EUR	500	300	0	107,116 %	535.579,00	0,52
3,8750 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-FLR M.-T. Nts 26(26/Und.) XS3281650823	EUR	1.100	1.100	0	96,313 %	1.059.444,10	1,04
3,8750 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EO-Medium-Term Nts 24(24/34) FR001400SIL1	EUR	100	0	500	96,524 %	96.524,00	0,09

SUIITE : État du patrimoine au 31 mars 2026

Code ISIN	Unités, Parts ou Devise en milliers	Quantité 31/03/2026	Achats/ entrées sur la période	Ventes/ sorties sous revue	Cours	Valeur de marché en EUR	en % des actifs du Fonds
TITRES NÉGOCIÉS EN BOURSE (SUIITE)							
Obligations							
2,6250 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN-HPF S.2125 v.22(28) DE000HV2AY12	EUR	200	0	0	99,365 %	198.729,60	0,19
5,8500 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 22(26/27) XS2555420103	EUR	700	0	0	101,771 %	712.397,00	0,70
0,0000 % VINCI S.A. EO-Med.-T. Notes 20(20/28) FR0014000PF1	EUR	100	100	0	91,680 %	91.679,50	0,09
2,7500 % Volkswagen Bank GmbH Med.Term.Nts. v.25(28) XS3099828355	EUR	900	300	0	98,510 %	886.590,00	0,87
3,1250 % Volkswagen Bank GmbH Med.Term.Nts. v.25(29) XS3195126084	EUR	600	0	0	97,867 %	587.199,60	0,58
3,7500 % Volkswagen Bank GmbH Med.Term.Nts. v.25(32) XS3249928394	EUR	700	700	0	97,733 %	684.129,60	0,67
5,4930 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 25(30/Und.) XS3071332962	EUR	500	400	400	99,996 %	499.982,00	0,49
3,8750 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.24(28) XS2745725155	EUR	500	0	0	100,833 %	504.165,00	0,49
5,0000 % Vonovia SE Medium T. Nts v.22(22/30) DE000A30VQB2	EUR	1.000	400	200	104,629 %	1.046.290,00	1,03
4,0000 % Vonovia SE Medium T. Nts v.25(25/36) XS3222746458	EUR	400	1.000	600	96,538 %	386.153,60	0,38
0,8750 % Royaume-Uni LS-Treasury Stock 21(33) GB00BM8Z2S21	GBP	1.000	2.600	5.600	76,841 %	879.489,53	0,86
1,5000 % Royaume-Uni LS-Treasury Stock 21(53) GB00BM8Z2V59	GBP	1.500	2.500	2.000	43,622 %	748.918,39	0,73

SUIITE : État du patrimoine au 31 mars 2026

Code ISIN	Unités, Parts ou Devise en milliers	Quantité 31/03/2026	Achats/ entrées sur la période sous revue	Ventes/ sorties	Cours	Valeur de marché en EUR	en % des actifs du Fonds
TITRES ADMIS OU INCLUS DANS DES MARCHÉS ORGANISÉS						6.201.704,41	6,08
Obligations						6.201.704,41	6,08
3,6250 % ASR Nederland N.V. EO-Bonds 23(23/28) XS2694995163	EUR	1.665	600	0	100,163 %	1.667.720,61	1,63
0,6250 % Digital Intrepid Holding B.V. EO-Bonds 21(21/31) Reg.S XS2280835260	EUR	1.300	200	300	83,674 %	1.087.756,80	1,07
0,1250 % Hamburger Hochbahn AG Anleihe v.21(30/31) XS2233088132	EUR	600	400	400	85,986 %	515.916,00	0,51
1,5750 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-FLR M.-T. Nts 21(21/Und.) XS2405855375	EUR	900	0	0	96,974 %	872.769,60	0,86
1,4500 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Notes 21(21/Und.) XS2295335413	EUR	400	0	0	98,500 %	394.000,00	0,39
0,0100 % Svenska Handelsbanken AB EO-Non-Preferred MTN 20(27) XS2265968284	EUR	400	0	700	95,042 %	380.166,40	0,37
3,2500 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 24(31) XS2888395659	EUR	800	0	0	98,285 %	786.280,00	0,77
3,2500 % TenneT Netherlands B.V. EO-Med.-Term Notes 26(36) XS3329155504	EUR	500	500	0	99,419 %	497.095,00	0,49
Total des valeurs mobilières ¹⁾						96.146.016,61	94,22

¹⁾ Les titres et les emprunts obligataires du Fonds sont partiellement couverts à l'aide d'opérations sur instruments financiers.

SUIITE : État du patrimoine au 31 mars 2026

Code	Marché	Quantité 31/03/2026	Achats/ entrées	Ventes/ sorties	Cours	Valeur de marché en EUR	en % des actifs du Fonds
Dérivés (Les positions dont le montant est précédé d'un signe moins sont des positions vendues.)						6.822,68	0,01
Dérivés de taux						-13.250,00	-0,01
Dettes/créances							
Contrats à terme sur taux						-13.250,00	-0,01
FUTURE ER-BXL 08.06.26 EUREX	185	EUR	1.000.000			13.800,00	0,01
FUTURE EURO-BUND 08.06.26 EUREX	185	EUR	1.000.000			-1.100,00	0,00
FUTURE EURO-SCHATZ 08.06.26 EUREX	185	EUR	5.000.000			-23.250,00	-0,02
FUTURE LONG TERM EURO BTP 08.06.26 EUREX	185	EUR	-1.500.000			-2.700,00	0,00
Dérivés de change						20.072,68	0,02
Dettes/créances							
Contrats de change à terme						20.072,68	0,02
FUTURE CROSS RATE EUR/GBP 15.06.26 CME	352	GBP	2.875.000		GBP 0,876	20.072,68	0,02

SUIITE : État du patrimoine au 31 mars 2026

Code	Quantité 31/03/2026	Achats/ entrées sur la période sous revue	Ventes/ sorties	Cours	Valeur de marché en EUR	en % des actifs du Fonds
AVOIRS BANCAIRES, INSTRUMENTS DU MARCHÉ MONÉTAIRE NON TITRISÉS ET FONDIS DU MARCHÉ MONÉTAIRE					4.507.492,76	4,42
Avoirs bancaires					4.507.492,76	4,42
Avoirs en EUR auprès de :						
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Succursale de Francfort-sur-le-Main					3.331.784,27	3,26
Avoirs en autres devises de l'UE/l'EEE auprès de :						
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Succursale de Francfort-sur-le-Main					NOK 1.672,30	149,00 0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Succursale de Francfort-sur-le-Main					SEK 348,42	31,74 0,00
Avoirs en devises autres que celles de l'UE/l'EEE auprès de :						
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Succursale de Francfort-sur-le-Main					AUD 710,89	422,57 0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Succursale de Francfort-sur-le-Main					CAD 60,29	37,49 0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Succursale de Francfort-sur-le-Main					GBP 1.021.055,85	1.168.657,26 1,15
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Succursale de Francfort-sur-le-Main					JPY 245.610,00	1.339,91 0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Succursale de Francfort-sur-le-Main					MXN 10,54	0,51 0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Succursale de Francfort-sur-le-Main					USD 5.841,67	5.070,01 0,00
Autres actifs					1.490.405,68	1,46
Intérêts à recevoir					1.341.376,57	1,31
Marges initiales					121.952,22	0,12
Marge de variation					27.050,00	0,03
Autres créances					26,89	0,00
Autres dettes					-104.113,34	-0,10
Frais de gestion					-57.712,05	-0,06
Frais de dépôt					-3.561,49	0,00
Frais d'audit					-5.983,56	-0,01
Frais de publication					-2.983,56	0,00
Marge de variation					-33.872,68	-0,03
Actifs du Fonds					102.046.624,39	100,00²⁾

ODDO BHF Green Bond CN-EUR

Valeur de la part	EUR	86,43
Prix d'émission	EUR	89,02
Prix de rachat	EUR	86,43
Parts en circulation	Unité	36.507

ODDO BHF Green Bond CR-EUR

Valeur de la part	EUR	270,46
Prix d'émission	EUR	278,57
Prix de rachat	EUR	270,46
Parts en circulation	Unité	314.577

ODDO BHF Green Bond DP-EUR

Valeur de la part	EUR	837,05
Prix d'émission	EUR	837,05
Prix de rachat	EUR	837,05
Parts en circulation	Unité	16.500

²⁾ L'arrondi des parts en pourcentage lors du calcul a pu entraîner des écarts d'arrondi minimes.

SUITE : État du patrimoine au 31 mars 2026

COURS DES TITRES/TAUX DU MARCHÉ

Les actifs du Fonds sont évalués sur la base des cours/taux du marché les plus récents.

Taux de change (cotation à l'incertain)

Dollar australien AD	AUD	1 EUR = 1,6823000	Peso mexicain MN	MXN	1 EUR = 20,7874000
Dollar canadien CD	CAD	1 EUR = 1,6079500	Couronne norvégienne NK	NOK	1 EUR = 11,2235500
Livre sterling LS	GBP	1 EUR = 0,8737000	Couronne suédoise SK	SEK	1 EUR = 10,9761500
Yen japonais YN	JPY	1 EUR = 183,3035000	Dollar américain DL	USD	1 EUR = 1,1522000

Légende des marchés

Marchés à terme

185 = Eurex Deutschland

352 = Chicago - CME Globex

Opérations conclues durant la période sous revue, dans la mesure où elles n'apparaissent plus dans l'état du patrimoine

Code	ISIN	Unités, Parts ou Devise en milliers	Achats ou entrées	Ventes ou sorties
------	------	---	-------------------------	-------------------------

TITRES NÉGOCIÉS EN BOURSE

Obligations

3,2500 % A2A S.p.A. EO-Medium-Term Nts 25(25/32)	XS3238204062	EUR	755	755
2,7500 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred Med.-T.Nts 25(29)	XS3083189319	EUR	0	300
2,7500 % Royaume de Belgique EO-Obl. Lin. 22(39)	BE0000356650	EUR	0	400
3,4940 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Preferred MTN 25(32/33)	FR0014012PH2	EUR	0	900
2,5000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.25 (35) Grüne	DE000BU3Z047	EUR	0	200
0,1000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-M.-T.Obl.Foncières 19(29)	FR0013459757	EUR	0	100
3,3750 % Caixabank S.A. EO-Pref.Med.-Term Nts 25(35)	XS3103589670	EUR	0	100
3,3090 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Preferred MTN 24(34)	FR001400TL81	EUR	0	100
0,0100 % DNB Boligkredit A.S. EO-Mortg. Covered MTN 21(31)	XS2289593670	EUR	0	100
4,1250 % E.ON SE Medium Term Notes v.24(43/44)	XS2791960664	EUR	0	100
4,7500 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 24(24/44)	FR001400QR88	EUR	0	500
4,2500 % Engie S.A. EO-Medium-Term Nts 23(23/43)	FR001400F1M1	EUR	600	900
3,0750 % Eurogrid GmbH MTN v.24(24/27)	XS2919679816	EUR	0	200
3,2500 % Knorr-Bremse AG MTN v.24(32/32)	XS2905504754	EUR	1.000	1.700
3,6250 % Lloyds Banking Group PLC EO-FLR Med.-Term Nts 25(35/36)	XS3010675695	EUR	0	200
3,3750 % RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 24(29/29)	FR001400U4M6	EUR	0	860
3,3750 % RCI Banque S.A. EO-Medium-Term Nts 25(30/30)	FR00140106Z3	EUR	0	510
3,8750 % Renault S.A. EO-Med.-Term Notes 25(25/30)	FR0014010DR1	EUR	0	600
3,3750 % Scot.Hydro-Electric Trans.PLC EO-Med.-T. Notes 24(24/32)	XS2894895684	EUR	0	273
0,7000 % Société des Grands Projets EO-Medium-Term Notes 20(60)	FR00140005R4	EUR	0	600
3,7500 % Stellantis N.V. EO-Med.-Term Notes 24(24/36)	XS2787827604	EUR	1.200	1.200
4,8750 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 24(24/Und.)	XS2783649176	EUR	0	500
3,0000 % Terna Rete Elettrica Nazio.SpA EO-Medium-T. Nts 25(25/31)	XS3128477521	EUR	0	500
0,0100 % UBS AG EO-Medium-Term Nts 21(26)	XS2358287238	EUR	0	200
5,9940 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 2025(33/Und.)	XS3071335478	EUR	400	400
4,0000 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.24(31)	XS2745726047	EUR	0	295

TITRES ADMIS OU INCLUS DANS DES MARCHÉS ORGANISÉS

Obligations

6,2500 % ABEILLE VIE SA d.Ass.V.e.d.C. EO-Obl. 22(22/33)	FR001400CHR4	EUR	600	600
4,5800 % Amprion GmbH MTN v. 26(45/46)	DE000A460EZ5	EUR	400	400
3,5000 % Danske Bank AS EO-FLR Med.-T.Nts 25(30/35)	XS3101509167	EUR	0	400
3,1250 % DSB SOV EO-Med.-Term Notes 24(24/34)	XS2847684938	EUR	0	807
4,1250 % Getlink SE EO-Notes 25(25/30)	XS2937174196	EUR	500	500

TITRES NON COTÉS ³⁾

Obligations

2,5000 % Digital Euro Finco LLC EO-Notes 19(19/26) Reg.S	XS1891174341	EUR	0	1.000
--	--------------	-----	---	-------

³⁾ Pour des raisons techniques, les titres non cotés peuvent également comporter des titres arrivant à échéance.

SUITE : Opérations conclues durant la période sous revue, dans la mesure où elles n'apparaissent plus dans l'état du patrimoine

Code	ISIN	Unités, Parts ou Devise en milliers	Achats ou entrées	Ventes ou sorties	Volume en milliers
INSTRUMENTS DÉRIVÉS					
(Primes d'option appliquées lors de transactions d'ouverture ou volume des opérations sur contrats conditionnels. Dans le cas de warrants, indication des acquisitions et cessions)					
CONTRATS À TERME (FUTURES)					
Contrats à terme sur taux					
contrats achetés :					
(Sous-jacent[s] : EURO-BOBL, EURO-BUND, EURO-BUXL, EURO-SCHATZ)		EUR			96.207,15
contrats vendus :					
(Sous-jacent[s] : 8,5-10,5Y.FR.GO.GB.SYN.AN, 8,5-10Y.ITA.GOV.BD.SYN.AN, BRITISCH LO.GILT SYN.AN., EURO-BOBL, EURO-BUND, EURO-BUXL, EURO-SCHATZ)		EUR			112.548,79
Contrats de change à terme					
contrats achetés :					
(Sous-jacent[s] : CROSS RATE EO/LS)		EUR			2.884,41

Aperçu des caractéristiques des catégories de parts	Montant minimum d'investissement en Devise	Frais d'entrée actuels (en %) ⁴⁾	Frais de gestion actuels (en % p.a.) ⁴⁾	Affectation des résultats	Devise
ODDO BHF Green Bond CN-EUR	100	3,00	0,450	Capitalisation	EUR
ODDO BHF Green Bond CR-EUR	100	3,00	0,750	Capitalisation	EUR
ODDO BHF Green Bond DP-EUR	2.000.000	0,00	0,150	Distribution avec distribution intermédiaire	EUR

⁴⁾ Le montant maximum est indiqué dans le Prospectus en vigueur.

Annexe conformément à la Section 7, n° 9 du KARBV

Volume de titres du Fonds (en %)	94,22
Volume de dérivés du Fonds (en %)	0,01

Autres informations

ODDO BHF Green Bond CN-EUR

Valeur de la part	EUR	86,43
Prix d'émission	EUR	89,02
Prix de rachat	EUR	86,43
Parts en circulation	Unité	36.507

ODDO BHF Green Bond CR-EUR

Valeur de la part	EUR	270,46
Prix d'émission	EUR	278,57
Prix de rachat	EUR	270,46
Parts en circulation	Unité	314.577

ODDO BHF Green Bond DP-EUR

Valeur de la part	EUR	837,05
Prix d'émission	EUR	837,05
Prix de rachat	EUR	837,05
Parts en circulation	Unité	16.500

Informations relatives à la procédure d'évaluation des actifs

Évaluation

En vertu des dispositions du Décret allemand sur la comptabilité et la valorisation des investissements (KARBV), ODDO BHF Asset Management GmbH (ODDO BHF AM GmbH), en tant que Société de gestion (KVG), procède à l'actualisation quotidienne, au moyen de processus adéquats, des estimations de prix utilisées pour tous les instruments détenus en portefeuille.

L'obligation d'évaluer les prix s'applique indépendamment de toute activité commerciale.

Afin de tenir compte de la diversité des instruments détenus, les processus utilisés sont régulièrement examinés, contrôlés et, s'il y a lieu, ajustés par un Comité d'évaluation. Le Comité d'évaluation poursuit les missions et objectifs suivants :

Missions

- Définition des processus d'évaluation et des sources de prix pour les différentes classes d'actifs
- Contrôle régulier des processus d'évaluation/de surveillance déterminés (p. ex. en situation de prix manquants (Missing Prices), de mouvements de prix importants (Price Movements) et de prix inchangés pendant des périodes prolongées (Stale Prices)), ainsi que des sources de prix privilégiées
- Décisions relatives à la marche à suivre en cas d'évaluations s'écartant du processus standard
- Décisions relatives aux procédés d'évaluation dans les cas particuliers (p. ex. valeurs mobilières illiquides)

Objectifs

- Communication des processus existants d'évaluation des prix aux activités concernées
- Optimisation continue des processus d'évaluation des prix

Un processus d'obtention des prix est désigné pour chaque instrument en fonction de ses caractéristiques. Ce processus inclut la définition des fournisseurs de données, des intervalles d'actualisation, de la sélection des sources de prix ainsi que de la procédure globale d'évaluation.

Outre les données obtenues sur les interfaces Bloomberg et Reuters, le processus s'appuie également sur d'autres sources de prix et d'estimations appropriées afin d'évaluer le prix des instruments pour lesquels aucune estimation adéquate n'est disponible auprès des sources de prix standard. De plus, le processus d'évaluation pourra se référer aux estimations d'arrangeurs (p. ex. dans le cas de titres adossés à des actifs). Dans le but de garantir la qualité continue du service d'estimation des prix, des routines de contrôle standardisées ont été mises en place à des fins d'assurance-qualité.

Les actifs individuels sont évalués comme suit :

Actifs cotés en bourse ou négociés sur un marché organisé

Les actifs qui sont admis à la négociation sur une place boursière ou inclus ou admis dans un autre marché organisé, de même que les droits de souscription détenus, sont évalués en fonction du dernier prix de transaction disponible représentant une évaluation fiable, sauf mention contraire ci-après.

Actifs ni cotés en bourse, ni négociés sur un marché organisé / Actifs sans cours de négociation

Les actifs qui ne sont ni cotés en bourse, ni admis ou inclus dans un autre marché organisé ou pour lesquels il n'existe pas de prix de transaction disponible, sont évalués à la valeur équitable adéquate sur la base d'une appréciation soignée à l'aide des modèles de valorisation adaptés et en tenant compte des conditions de marché globales, sauf mention contraire ci-après. Le terme de « valeur équitable » correspond ici au montant contre lequel pourrait s'échanger l'actif dans des conditions de concurrence normales entre parties informées et consentantes.

Obligations non cotées et emprunts obligataires

S'agissant de l'évaluation des obligations qui ne sont ni admises à la négociation sur une place boursière, ni admises ou incluses dans un autre marché organisé (p.ex. obligations non cotées, billets de trésorerie et certificats de dépôt) et de l'évaluation des emprunts obligataires, les prix établis pour des obligations similaires ou, le cas échéant, les prix de marché d'obligations d'émetteurs similaires ayant une échéance et des taux d'intérêt identiques sont utilisés, en appliquant si nécessaire une décote afin de refléter leur négociabilité limitée.

Instruments du marché monétaire

S'agissant des instruments du marché monétaire, la Société de gestion peut procéder au calcul du prix des parts en tenant compte des taux et intérêts applicables jusqu'au jour civil (inclus) précédant le jour d'évaluation. Dans ce cadre, la Société de gestion doit comptabiliser comme revenus les intérêts courus au titre de chaque investissement. Toutes les charges non encore exigibles de la Société de gestion, telles que les commissions de gestion, les frais de dépositaire, les frais d'audit et de publication, etc., ayant une incidence sur le prix des parts, peuvent être comptabilisées comme dépenses.

Dans le cadre des instruments du marché monétaire détenus par le Fonds, les intérêts et revenus assimilés, ainsi que les charges (p.ex. commissions de gestion, frais de dépositaire, frais d'audit et de publication, etc.) peuvent être pris en considération jusqu'au jour (inclus) précédant le jour d'évaluation.

Options et contrats à terme « future »

Lorsqu'elles sont admises à la négociation sur une place boursière ou incluses dans un autre marché organisé, les options appartenant à un fonds et les passifs sur toute option octroyés à un tiers sont évalués au prix de négociation le plus récent qui garantit une valorisation fiable.

Cela s'applique également à toutes les dettes et créances sur contrats à terme « future » vendus pour le compte du Fonds. Tous paiements de marge effectués à la charge du Fonds seront ajoutés à la valeur du Fonds, en tenant compte des gains et des pertes de valorisation constatés au jour de bourse.

Dépôts bancaires, dépôts à terme, parts de fonds de placement et prêts

Les dépôts bancaires sont généralement évalués à leur valeur nominale majorée des intérêts cumulés.

Les dépôts à terme sont évalués à leur valeur équitable, sachant qu'ils peuvent être résiliés à tout moment et que le rachat au moment de la résiliation n'est pas calculé à la valeur nominale majorée des intérêts.

Les parts de fonds de placement sont généralement évaluées à leur prix de rachat le plus récent ou au dernier prix de négociation disponible qui garantit une évaluation équitable. Si ces prix ne sont pas disponibles, les parts de fonds de placement sont évaluées à leur valeur équitable appropriée sur la base d'une évaluation soignée, réalisée à l'aide de modèles de valorisation adaptés et en tenant compte des conditions de marché globales.

Les dettes sont comptabilisées à leur montant de remboursement.

Les demandes de remboursement dans le cadre d'opérations de prêt de titres sont appréciées au regard du cours coté de l'actif prêté.

Actifs libellés en devises étrangères

Les actifs libellés en devises étrangères sont convertis sur la base du World Market Rate déterminé à 17h00 (source : Datastream) le jour de valorisation considéré.

Düsseldorf, le 1er avril 2026

ODDO BHF Asset Management GmbH
La Direction

Autres informations

Données conformes au Règlement (UE) 2015/2365 relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation et modifiant le règlement (UE) no 648/2012 – Information conformément à la section A

Aucune opération de financement sur titres ni aucun swap sur rendement total n'a été conclu(e) durant la période sous revue, conformément à la disposition légale susmentionnée.

Aperçu des partenaires de ODDO BHF Green Bond

ODDO BHF Asset Management GmbH

Herzogstraße 15
40217 Düsseldorf
Adresse postale :
Boîte postale 10 53 54, 40044 Düsseldorf
Téléphone : +49 (0) 211 2 39 24- 01

Succursale de Francfort-sur-le Main
Gallusanlage 8
60329 Francfort-sur-le Main
Adresse postale :
Boîte postale 11 07 61, 60042 Francfort-sur-le Main
Téléphone : +49 (0) 69 9 20 50-0
Fax : +49 (0) 69 9 20 50- 103

ODDO BHF Asset Management GmbH est détenue
à 100 % par ODDO BHF SE

DÉPOSITAIRE

The Bank of New York Mellon SA/NV
Asset Servicing, Succursale de Francfort-sur-le-Main
MesseTurm, Friedrich-Ebert-Anlage 49
60327 Francfort-sur-le-Main

DIRECTION

Nicolas Chaput

Porte-Parole
Également Président d'ODDO BHF
Asset Management SAS et
d'ODDO BHF Private Equity SAS

Dr Stefan Steurer

Bastian Hoffmann

Également Président du Conseil d'administration
d'ODDO BHF Asset Management Lux

CONSEIL DE SURVEILLANCE

Werner Taiber

Président
Düsseldorf, Président du Conseil de Surveillance
d'ODDO BHF SE, Francfort-sur-le-Main

Noémie Ellezam

Paris, Chief Marketing and Data Officer
d'ODDO BHF SCA, Paris

Christophe Tadié

Francfort-sur-le-Main, membre du Conseil de gestion
d'ODDO BHF SE, Francfort-sur-le-Main et d'ODDO BHF SCA, Paris

Dr Alexander Ilgen

Francfort-sur-le-Main, membre du Conseil de gestion
d'ODDO BHF SE, Francfort-sur-le-Main et d'ODDO BHF SCA, Paris

Thomas Seale

Bereldange, membre indépendant du Conseil de Surveillance

Olivier Marchal

Suresnes, Président de Bain & Company France et
Président du Conseil de Surveillance d'ODDO BHF SCA, Paris

GÉRANT DU FONDS

ODDO BHF Asset Management SAS
12 Boulevard de la Madeleine
75009 Paris
France

Toutes les données s'entendent à mars 2026

ODDO BHF Asset Management GmbH

Herzogstraße 15
40217 Düsseldorf
Adresse postale :
Boîte postale 10 53 54
40044 Düsseldorf

Succursale de Francfort-sur-le-Main
Gallusanlage 8
60329 Francfort-sur-le-Main
Adresse postale :
Boîte postale 110761
60042 Francfort-sur-le-Main
Téléphone: +49 (0) 69 92050-0
Fax: +49 (0) 69 920 50 - 103

am.oddo-bhf.com



ODDO BHF
ASSET MANAGEMENT