



Arrêté Semestriel au 31 octobre 2018

ODDO BHF PATRIMOINE

FCP de Droit Français

**LE DOCUMENT D'INFORMATION SEMESTRIELLE NE FAIT PAS L'OBJET D'UNE CERTIFICATION
PAR LE COMMISSAIRE AUX COMPTES DE L'OPCVM**

ETAT DU PATRIMOINE

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Les titres financiers mentionnés au 1er du I de l'article L. 214-24-55 du code monétaire et financier	70 651 547,38
b) Avoirs bancaires	20 719 538,14
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	273 601 742,93
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	364 972 828,45
e) Passif	-10 616 278,95
f) Valeur nette d'inventaire	354 356 549,50

* Les montants sont signés

NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur liquidative
OddBHFPa A C	C1	323,705,018.67	14,586,349.1450	22.19
OddBHFPa B C	C2	1,556,930.75	13.8580	112,348.87
OddBHFPa GC C	C3	29,094,600.08	273,690.2310	106.30

ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1	18.23	17.7
b) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, " & "en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen	0	0
c) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers " & "ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie " & "par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	14.97	14.53
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier ;	0	0
e) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	56.27	54.63

REPARTITION DES ACTIFS PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
US ILB 150128	USD	37,574,902.27	10.6	10.3
US ILB 150727	USD	15,467,211.76	4.36	4.24
TOTAL	USD	53,042,114.03	14.97	14.53
MulUtsLu LyUS10IE AC	EUR	46,994,571.00	13.26	12.88
TOTAL	EUR	46,994,571.00	13.26	12.88
Norway 4.5 220519	NOK	17,609,433.35	4.97	4.82
TOTAL	NOK	17,609,433.35	4.97	4.82

REPARTITION DES ACTIFS PAR SECTEUR ECONOMIQUE

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Emetteur souverain et administration centrale publ	19.94	19.35
Organisme de Placement Collectif	13.26	12.88
TOTAL	33.2	32.23

REPARTITION DES ACTIFS PAR PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
ETATS-UNIS D'AMERI.	14.97	14.53
LUXEMBOURG	13.26	12.88
NORVEGE	4.97	4.82
TOTAL	33.2	32.23

VENTILATION DES AUTRES ACTIFS PAR NATURE

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
a) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier	80,298,012.78	32,331,959.79
b) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen	0.00	0.00
c) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	51,603,838.06	57,885,099.66
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier ;	0.00	0.00
e) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	279,280,280.87	395,193,467.64

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	411 182 131,71
Cessions	485 410 527,09

Fonds	ODDO BHF PATRIMOINE (8092)
Date	31/10/2018
Actif Net	354,356,549.5 EUR

classification	code titre	libelle	devise	Quantité	Cours	valeur boursière	% Actif Net
Disponibilités						41 468 225.49	11.70%
		ODDO & Cie SA	EUR	1 545 125.54	1.00	1 545 125.54	0.44%
			USD	(2 521 778.27)	0.88	-2 228 900.72	-0.63%
			CHF	0.42	0.88	0.37	0.00%
			GBP	1.14	1.13	1.29	0.00%
			NOK	182 367 841.10	0.11	19 174 410.94	5.41%
		Cion performance	EUR	(14 328.87)	1.00	-14 328.87	0.00%
		Cion de gestion	EUR	(470 062.27)	1.00	-470 062.27	-0.13%
		CdtDiv Autres EUR	EUR	(2 383 303.92)	1.00	-2 383 303.92	-0.67%
		Appel de marge/fut.	EUR	100 800.00	1.00	100 800.00	0.03%
			USD	6 587 601.87	0.88	5 822 522.42	1.64%
			JPY	(1.00)	0.01	-0.01	0.00%
		DG-M à terme ferme	EUR	1 242 783.60	1.00	1 242 783.60	0.35%
			USD	7 114 400.00	0.88	6 288 138.59	1.77%
		DebDiv Autres USD	USD	2 706 622.93	0.88	2 392 277.65	0.68%
		DebDiv Autres EUR	EUR	601 690.88	1.00	601 690.88	0.17%
		ODDO ET CIE PARIS	EUR	10 000 000.00	1.00	10 000 000.00	2.82%
		CdtDiv Autres USD	USD	(682 155.00)	0.88	-602 930.00	-0.17%
UCITS						246 391 027.15	69.53%
	FR0011360171	Oddo Tresorerie 3-6 Mois CI EUR Cap	EUR	2 290.00	10 665.09	24 423 056.10	6.89%
	FR0010251108	Oddo BHF Avenir Europe CI-EUR Cap	EUR	64.80	341 424.23	22 124 290.10	6.24%
	FR0010576728	ODDO BHF Generation B Cap	EUR	54.30	221 678.14	12 037 123.00	3.40%
	LU1833930222	SICAV Oddo BHF GI Credit Short Duration CF EUR Cap	EUR	15 000.00	999.41	14 991 075.00	4.23%
	FR0011570621	Oddo BHF Algo Min Var CI Cap	EUR	6 377.00	1 478.81	9 430 371.37	2.66%
	LU1390062831	Multi Units Lux Lyxor USD 10Y Infl Expec UCITS ETF Acc Cap	EUR	503 100.00	93.41	46 994 571.00	13.26%
	FR0010680157	Oddo BHF Jour CI EUR Cap	EUR	10 840.00	2 381.24	25 812 641.60	7.28%
	LU1653088168	BlackRock Strateg Fds Amer Divers Eq Abs Ret I2 Cap	USD	94 100.00	106.61	8 866 891.46	2.50%
	FR0011294586	Oddo Convertible Euro Moderate CI EUR Cap	EUR	7 930.00	1 165.57	9 242 970.10	2.61%
	DE000A0YCBP0	Oddo BHF Algo Europe CIW EUR T Cap	EUR	53 400.00	93.32	4 983 288.00	1.41%
	LU1833929307	SICAV Oddo BHF Algo Trend US CI Cap	EUR	6 030.00	980.28	5 911 088.40	1.67%
	FR0013189289	Oddo BHF Horizon Alpha CI EUR Cap	EUR	4 000.00	929.91	3 719 640.00	1.05%
	LU0628638206	SICAV Oddo BHF EUR Cred Short Duration CP Cap	EUR	3 888 000.00	10.93	42 491 952.00	11.99%
	FR0010251124	Oddo BHF Immobilier CI-EUR Cap	EUR	38.00	202 316.29	7 688 019.02	2.17%
	LU1330044246	FT Alpha Europe Market Neutral IT Cap	EUR	155 000.00	49.51	7 674 050.00	2.17%
Appels de marges						-4 341 010.52	-1.23%
		EUR FUT 12/18 CME	USD	900.00	1.14	-2 820 659.14	-0.80%
		S&P 500 Index FUT 12/18 CME	USD	247.00	2 711.00	-855 831.27	-0.24%
		Euro Stoxx 50 EUR (Price) Index FUT 12/18 EUX	EUR	560.00	3 194.00	184 800.00	0.05%
		Nasdaq 100 Stock Index FUT 12/18 CME	USD	427.00	6 975.50	-1 237 913.20	-0.35%
		US Treasury Note 10 Years FUT 12/18 CBOT	USD	(320.00)	118.44	390 942.64	0.11%
		Japan Govt Bond 6% 10 Year FUT 12/18 OSE	JPY	(6.00)	150.63	-2 349.55	0.00%
Obligations négociées sur un marché réglementé ou assimilé						70 651 547.38	19.94%
	US9128283R96	US ILB Ser A-2028 Sen 18/15.01.28	USD	43 900 000.00	96.69	37 574 902.27	10.60%
	US9128282L36	US ILB T-Notes Ser D-2027 Sen 17/15.07.27	USD	18 000 000.00	97.11	15 467 211.76	4.36%
	NO0010429913	Norway 4.5% 08/22.05.19	NOK	161 000 000.00	102.01	17 609 433.35	4.97%
Options						186 760.00	0.05%
		Euro Stoxx 50 EUR (Price) Index CALL 11/18 EUX 3150	EUR	230.00	81.20	186 760.00	0.05%
Actif Net						354 356 549.50	100.00%

ODDO BHF HAUT RENDEMENT 2021

Securities Financing Transactions Regulation

28-09-2018

EUR

Actifs engagés pour chaque type d'opérations de financement sur titres et Total Return Swaps exprimés en valeur absolue et en pourcentage de l'actif net du fonds

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
Montant	473 235.00		6 254 224.08		
% de l'actif net total	0.09%		1.24%		

Montant des titres et matières premières prêtés en proportion des actifs

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
Montant des actifs prêtés	473 235.00				
% des actifs pouvant être prêtés	0.09%				

10 principaux émetteurs de garanties reçues (hors liquidités) pour tous les types d'opérations de financement (volume de garanties au titre des transactions en cours)

1. Nom	
Volume des garanties reçues	
2. Nom	
Volume des garanties reçues	
3. Nom	
Volume des garanties reçues	
4. Nom	
Volume des garanties reçues	
5. Nom	
Volume des garanties reçues	
6. Nom	
Volume des garanties reçues	
7. Nom	
Volume des garanties reçues	
8. Nom	
Volume des garanties reçues	
9. Nom	
Volume des garanties reçues	
10. Nom	
Volume des garanties reçues	

10 principales contreparties en valeur absolue des actifs et des passifs sans compensation

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
1. Nom	ODDO BHF SCA		ODDO BHF SCA		
Montant	473 235.00		6 254 224.08		
Domicile	PARIS		PARIS		
2. Nom					
Montant					
Domicile					
3. Nom					
Montant					

Domicile				
4. Nom				
Montant				
Domicile				
5. Nom				
Montant				
Domicile				
6. Nom				
Montant				
Domicile				
7. Nom				
Montant				
Domicile				
8. Nom				
Montant				
Domicile				
9. Nom				
Montant				
Domicile				
10. Nom				
Montant				
Domicile				

Type et qualité des garanties (collatéral)

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
Type et qualité de la garantie					
Liquidités	498 750.00		6 270 771.16		
Instruments de dette					
Notation de bonne qualité					
Notation de moyenne qualité					
Notation de faible qualité					
Actions					
Notation de bonne qualité					
Notation de moyenne qualité					
Notation de faible qualité					
Parts de fonds					
Notation de bonne qualité					
Notation de moyenne qualité					
Notation de faible qualité					
Monnaie de la garantie					
Pays de l'émetteur de la garantie					

Échéance de la garantie, ventilée en fonction des tranches ci-dessous

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois					
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an					
plus d'1 an					
ouvertes					

Échéance des opérations de financement sur titres et total return swaps ventilée en fonction des tranches ci-dessous

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois					
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an					
plus d'1 an					
ouvertes	473 235.00		6 254 224.08		

Règlement et compensation des contrats

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
Contrepartie centrale					
Bilatéraux					
Trois parties					

Données sur la réutilisation des garanties

	Espèces	Titres
Montant maximal (%)		
Montant utilisé (%)		
Revenus pour l'OPC suite au réinvestissement des garanties espèces des opérations de financement sur titres et TRS		

Données sur la conservation des garanties reçues par l'OPC

1. Nom	ODDO BHF SCA
Montant conservé	6 760 521.16

Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Montant total du collatéral versé

En % de toutes les garanties versées

Comptes séparés

Comptes groupés

Autres comptes

Données sur les revenus ventilées

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
OPC					
Montant	67 055.98		75 160.74	36.94	
en % des revenus	0.54%		0.61%	0.00%	
Gestionnaire					
Montant					
en % des revenus					
Tiers (ex. agent prêteur...)					
Montant					
en % des revenus					

Données sur les coûts ventilées

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
OPC					
Montant					
Gestionnaire					
Montant					
Tiers (ex. agent prêteur...)					
Montant					