



Arrêté Semestriel au 31 décembre 2018

Oddo BHF European Convertibles Moderate

Fonds Commun de Placement 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

Éléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers mentionnés au 1er du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	95 090 474,92
b) Avoirs bancaires	5 742 182,09
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	31 529 960,33
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	132 362 617,34
e) Passif	-21 687 442,36
f) Valeur nette d'inventaire	110 675 174,98

* 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
Part CR-EUR	Capitalisation	60 934 442.28	401 203.6040	151.87
Part CI-EUR	Capitalisation	38 699 148.82	34 387.6210	1 125.38
Part GC-EUR	Capitalisation	1 293 492.93	13 392.9390	96.58
Part CR-CHF	Capitalisation	685 329.44	8 875.0000	77.22
Part CI-CHF	Capitalisation	6 467 308.06	7 738.1680	835.76
Part CRe-EUR	Capitalisation	45 675.08	496.0790	92.07
Part CN-EUR	Capitalisation	2 549 778.37	26 089.6010	97.73

ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Titres financiers éligibles et 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	84.09	70.31
b) Titres financiers éligibles et 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) Titres financiers éligibles et 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	0.71	0.59
d) 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) Autres actifs : il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	7.10	5.93

REPARTITION DES ACTIFS PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
Telecolt 1.12 260322	EUR	6 973 883.27	6.30	5.27
DeutWohn 0.32 260724	EUR	5 260 853.45	4.75	3.97
Iberdrln 0 111122	EUR	4 540 888.00	4.10	3.43
Freseniu 0 310124	EUR	4 200 988.00	3.80	3.17
Airbus 0 140621	EUR	4 175 402.00	3.77	3.15
SAFRAN 0 210623	EUR	3 871 153.00	3.50	2.92
DeutWohn 0.6 050126	EUR	3 716 989.93	3.36	2.81
LEGIImm 0.87 010925	EUR	3 541 303.38	3.20	2.68
DtPost 0.05 300625	EUR	3 059 628.05	2.76	2.31
CellTele 1.5 160126	EUR	3 019 910.17	2.73	2.28
MTUAeEng 0.12 170523	EUR	2 913 626.30	2.63	2.20
DEAFin 7.5 151022	EUR	2 668 787.50	2.41	2.02
Bayer 0.05 150620	EUR	2 585 262.45	2.34	1.95
RAGStift 0 160323	EUR	2 556 554.00	2.31	1.93
UBISOFE 0 270921	EUR	2 358 770.40	2.13	1.78
LEGIImm 0.5 010721	EUR	2 239 831.86	2.02	1.69
Faurecia 2.62 150625	EUR	2 091 457.50	1.89	1.58
Freseniu 0 240919	EUR	1 882 998.00	1.70	1.42
Snam 0 200322	EUR	1 697 433.00	1.53	1.28
RAGStift 0 180221	EUR	1 693 293.50	1.53	1.28
TAGImm 0.62 010922	EUR	1 543 309.15	1.39	1.17
CorCapHg 1.37 281122	EUR	1 507 547.85	1.36	1.14
ORPAR 0 200624	EUR	1 503 727.50	1.36	1.14
Prysmian 0 170122	EUR	1 462 912.00	1.32	1.11
FresenMC 1.12 310120	EUR	1 459 190.63	1.32	1.10
Airbus 0 010722	EUR	1 455 116.00	1.31	1.10
ArchObli 0 310323	EUR	1 433 016.00	1.29	1.08
CorpEcoD 1 011223	EUR	1 171 705.91	1.06	0.89
Almirall 0.25 141221	EUR	1 158 920.38	1.05	0.88
CredAgri 0 031019	EUR	1 062 758.55	0.96	0.80
Adidas 0.05 120923	EUR	1 040 189.79	0.94	0.79
Loxam 4.25 150424	EUR	928 083.00	0.84	0.70
Elis 2.87 150226	EUR	902 315.71	0.82	0.68
ArdPacUS 2.75 150324	EUR	891 544.50	0.81	0.67
ENCEEner 1.25 050323	EUR	851 966.92	0.77	0.64
Elis 0 061023	EUR	796 204.51	0.72	0.60
CAImm 0.75 040425	EUR	782 470.50	0.71	0.59
TechnFMC 0.87 250121	EUR	724 857.19	0.65	0.55
Nexity 0.25 020325	EUR	688 714.81	0.62	0.52
SillIntec 0 280623	EUR	561 925.90	0.51	0.42
BESemiln 0.5 061224	EUR	470 742.00	0.43	0.36
Aroundto Be	EUR	252 700.00	0.23	0.19

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
TOTAL	EUR	87 698 932.56	79.24	66.26
Michelin 0 101123	USD	1 906 200.35	1.72	1.44
Qiagen 1 131124	USD	1 043 967.34	0.94	0.79
Total 0.5 021222	USD	725 176.24	0.66	0.55
TOTAL	USD	3 675 343.93	3.32	2.78
RemJeGBP 2.62 220321	GBP	1 300 481.40	1.18	0.98
TOTAL	GBP	1 300 481.40	1.18	0.98
Sika 0.15 050625	CHF	1 176 004.53	1.06	0.89
TOTAL	CHF	1 176 004.53	1.06	0.89

REPARTITION DES ACTIFS PAR SECTEUR ECONOMIQUE

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Gestion et promotion immobilière	18.71	15.63
Autres services financiers	13.31	11.13
Industrie aérospatiale et défense	11.22	9.38
Produits pharmaceutiques	8.88	7.43
Services de télécommunication intégrés	6.30	5.27
Courrier, Fret aérien et Logistique	2.76	2.31
Autres secteurs	23.62	19.75
TOTAL	84.80	70.90

REPARTITION DES ACTIFS PAR PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
ALLEMAGNE	34.06	28.46
FRANCE	17.01	14.23
PAYS-BAS	10.56	8.83
Autres pays	23.17	19.38
TOTAL	84.80	70.90

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
a) Titres financiers éligibles et 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	24 534 456.35	46 316 766.63
b) Titres financiers éligibles et 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) Titres financiers éligibles et 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	0.00	1 450 642.68
d) 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) Autres actifs : il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	6 428 022.00	11 888 654.70

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	30 962 478,35
Cessions	59 656 064,01

Fonds	ODDO BHF EUROPEAN CONVERTIBLES MODERATE (8062)
Date	31/12/2018
Actif Net	110,675,174.98 EUR

classification	code titre	libelle	devise	Quantité	Cours	valeur boursière	% Actif Net
Disponibilités						11 506 860.11	10.40%
	ODDO & Cie SA		EUR	5 737 244.41	1.00	5 737 244.41	5.18%
			USD	3 762.43	0.87	3 291.71	0.00%
			CHF	(268 051.48)	0.89	-237 966.24	-0.22%
			GBP	1 478.00	1.11	1 645.97	0.00%
	Cion de gestion		EUR	(76 855.07)	1.00	-76 855.07	-0.07%
			CHF	(4 715.40)	0.89	-4 186.16	0.00%
	CPTN EONIA 0.00 0712		EUR	(74 108.27)	1.00	-74 108.27	-0.07%
	CPTN EONIA 0.00 2211		EUR	(246 393.00)	1.00	-246 393.00	-0.22%
	CPTN EONIA 0.00 1411		EUR	(644 175.00)	1.00	-644 175.00	-0.58%
	BUY CHF EUR 15/01/2019 G4		EUR	791 000.00	0.89	1 190.57	0.00%
	SELL GBP EUR 15/01/2019		EUR	(1 164 000.00)	1.11	-1 320.31	0.00%
	CPTN EONIA 0.00 2911		EUR	(2 010 487.50)	1.00	-2 010 487.50	-1.82%
	ODDO ET CIE PARIS		EUR	9 748 919.98	1.00	9 748 934.42	8.81%
	ADM Repo - ODDO EUR		EUR	100 000.00	1.00	100 000.00	0.09%
	BUY USD EUR 15/01/2019		EUR	198 011.00	0.87	663.20	0.00%
	BUY CHF EUR 15/01/2019 G5		EUR	7 336 000.00	0.89	11 041.70	0.01%
	SELL CHF EUR 15/01/2019 G4		EUR	(13 633.00)	0.89	9.22	0.00%
	DebDiv Opecont EUR		EUR	406.68	1.00	406.68	0.00%
	SELL USD EUR 15/01/2019		EUR	(4 442 000.00)	0.87	24 967.67	0.02%
	SELL CHF EUR 15/01/2019		EUR	(1 330 000.00)	0.89	-963.60	0.00%
	ADM OTC - SOGENE EUR		EUR	20 000.00	1.00	20 000.00	0.02%
	CPTN EONIA 0.00 1812		EUR	(405 152.48)	1.00	-405 152.48	-0.37%
	CPTN EONIA 0.00 1112		EUR	(148 299.11)	1.00	-148 299.11	-0.13%
	CPTN EONIA 0.00 0711		EUR	(292 628.70)	1.00	-292 628.70	-0.26%
Créances représentatives des titres prêtés en pension						2 175.23	0.00%
	FR0013284130 221119		EUR	234 660.00	-	241.99	0.00%
	FR0013344033 071119		EUR	278 694.00	-	235.15	0.00%
	XS1583310807 110919		EUR	882 000.00	-	479.59	0.00%
	FR0013285707 111219		EUR	141 237.25	-	89.45	0.00%
	FR0013344033 181219		EUR	385 859.50	-	192.93	0.00%
	XS1434160971 291119		EUR	1 032 750.00	-	484.10	0.00%
	XS1321004118 141119		EUR	613 500.00	-	402.61	0.00%
	FR0013285707 071219		EUR	70 579.30	-	49.41	0.00%
Obligations négociées sur un marché réglementé ou assimilé						93 935 459.21	84.87%
	CH0413990240	Sika AG 0.15% Conv Sen Reg S 18/05.06.25	CHF	1 300 000.00	101.81	1 176 004.53	1.06%
	DE000A2DAHU1	Fresenius SE & Co KGaA 0% Conv 17/31.01.24	EUR	4 400 000.00	95.48	4 200 988.00	3.80%
	DE000A2G87D4	Deutsche Post AG 0.05% Conv Sen Reg S 17/30.06.25	EUR	3 200 000.00	95.61	3 059 628.05	2.76%
	DE000A2LQRW5	Adidas AG 0.05% Conv Sen Reg S 18/12.09.23	EUR	1 000 000.00	104.00	1 040 189.79	0.94%
	XS1919894813	Almirall SA 0.25% Sen Conv 18/14.12.21	EUR	1 200 000.00	96.56	1 158 920.38	1.05%
	FR0013246147	ORPAR 0% Conv RemCoint Reg S 17/20.06.24	EUR	1 500 000.00	100.25	1 503 727.50	1.36%
	FR0013344033	SAFRAN SA 0% Conv Sen Reg S 18/21.06.23	EUR	26 000.00	148.89	3 871 153.00	3.50%
	XS1908221507	Qiagen NV 1% Conv Sen Reg S 18/13.11.24	USD	1 200 000.00	99.30	1 043 967.34	0.94%
	XS1254584599	Airbus SE 0% Conv EMTN Reg S Ser AIR 15/01.07.22	EUR	1 300 000.00	111.93	1 455 116.00	1.31%
	DE000LEG1CB5	LEG Immobilien AG 0.5% Conv Sen 14/01.07.21	EUR	1 300 000.00	172.18	2 239 831.86	2.02%
	XS1750026186	Cellnex Telecom SA 1.5% Conv EMTN Sen Reg S 18/16.01.26	EUR	2 900 000.00	102.69	3 019 910.17	2.73%
	XS1321004118	Iberdrola Intl BV 0% Conv Reg S Iberdrola SA 15/11.11.22	EUR	4 400 000.00	103.20	4 540 888.00	4.10%
	FR0013284130	Archer Obligations SA 0% Conv Kering Ser KER Sen 17/31.03.23	EUR	1 200 000.00	119.42	1 433 016.00	1.29%
	FR0013208295	Crédit Agricole SA 0% Conv Reg S Sen Eurazeo SA16/03.10.19	EUR	14 700.00	72.30	1 062 758.55	0.96%
	XS1351586588	TechnipFMC Plc 0.875% Conv Reg S 16/25.01.21	EUR	700 000.00	103.17	724 857.19	0.65%
	DE000A2E4GF6	Bayer AG 0.05% Conv Covestro Ser 1COV Sen Reg S 17/15.06.20	EUR	2 600 000.00	99.41	2 585 262.45	2.34%
	DE000A2AAQB8	MTU Aero Engines AG 0.125% Conv Reg S Sen 16/17.05.23	EUR	2 100 000.00	138.67	2 913 626.30	2.63%
	XS1492150260	Corporacion Economica Damm SA 1% Conv EbroFood 16/01.12.23	EUR	1 200 000.00	97.55	1 171 705.91	1.06%
	XS1590066624	Loxam 4.25% Sen Reg S 17/15.04.24	EUR	900 000.00	101.14	928 083.00	0.84%
	FR0013309184	Michelin SA 0% Conv 18/10.11.23	USD	2 600 000.00	83.80	1 906 200.35	1.72%
	FR0013285707	Elis SA 0% Conv Ser Elis Sen Reg S 17/06.10.23	EUR	27 300.00	29.17	796 204.51	0.72%
	XS1583310807	Snam SpA 0% Conv 17/20.03.22	EUR	1 700 000.00	99.85	1 697 433.00	1.53%
	XS1551933010	Prysman SpA 0% Conv Reg S Ser PRY1 17/17.01.22	EUR	1 600 000.00	91.43	1 462 912.00	1.32%
	DE000A2GSDH2	LEG Immobilien AG 0.875% Sen Reg S Conv 17/01.09.25	EUR	3 300 000.00	107.01	3 541 303.38	3.20%
	DE000A14J3R2	RAG-Stiftung 0% EMTN Conv Evonik Indust AG Reg S 15/18.02.21	EUR	1 700 000.00	99.61	1 693 293.50	1.53%
	XS1785467751	Faurecia SA 2.625% Sen Reg S 18/15.06.25	EUR	2 200 000.00	94.94	2 091 457.50	1.89%
	XS1327914062	Total SA 0.5% Conv Ser FP 15/02.12.22	USD	800 000.00	103.57	725 176.24	0.66%
	FR0013345949	Silicon On Insulator Tec 0% Conv Soitec Sen Reg S 8/28.06.23	EUR	6 100.00	92.12	561 925.90	0.51%
	XS1498935391	DEA Finance SA 7.5% Reg S Sen 16/15.10.22	EUR	2 500 000.00	105.13	2 668 787.50	2.41%
	XS1731596257	BE Semiconductor Industries NV 0.5% Conv Sen 17/06.12.24	EUR	600 000.00	78.42	470 742.00	0.43%
	DE000A1YC3T6	Fresenius SE & Co KGaA 0% Conv Reg S 14/24.09.19	EUR	1 800 000.00	104.61	1 882 998.00	1.70%
	DE000A2BPB84	Deutsche Wohnen SE 0.325% Conv Sen Reg S 17/26.07.24	EUR	4 900 000.00	107.22	5 260 853.45	4.75%
	XS1574148877	Ardagh Pac Fin Plc Hgs USA Inc 2.75% Reg S Sen 17/15.03.24	EUR	900 000.00	98.24	891 544.50	0.81%
	XS1209185161	Telecom Italia SpA 1.125% Conv Sen 15/26.03.22	EUR	7 400 000.00	93.93	6 973 883.27	6.30%
	XS1383319974	Remgro Jersey GBP Ltd 2.625% Conv MediIntl 16/22.03.21	GBP	1 200 000.00	96.57	1 300 481.40	1.18%
	DE000A2GS3Y9	TAG Immobilien AG 0.625% Conv Sen Reg S 17/01.09.22	EUR	1 300 000.00	118.50	1 543 309.15	1.39%
	DE000A13R491	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 1.125% Sen 14/31.01.20	EUR	1 400 000.00	103.75	1 459 190.63	1.32%
	XS1783932863	ENCE Energia y Celulosa SA 1.25% Conv Sen Reg S 18/05.03.23	EUR	800 000.00	106.08	851 966.92	0.77%
	XS1434160971	Airbus SE 0% Conv DassAvia EMTN Reg S Sen 16/14.06.21	EUR	3 800 000.00	109.88	4 175 402.00	3.77%
	DE000A2GS377	Deutsche Wohnen SE 0.6% Conv Sen Reg S 17/05.01.26	EUR	3 500 000.00	105.60	3 716 989.93	3.36%
	FR0013321429	Nexity 0.25% Conv Sen 18/02.03.25	EUR	10 832.00	63.58	688 714.81	0.62%
	DE000A19SPK4	Corestate Capital Holding SA 1.375% Conv Sen 17/28.11.22	EUR	1 600 000.00	94.09	1 507 547.85	1.36%
	AT0000A1YDF1	CA-Immobilien-Anlagen AG 0.75% Conv Sen 17/04.04.25	EUR	700 000.00	111.59	782 470.50	0.71%
	DE000A2BPE24	RAG-Stiftung 0% Conv Evonilnd Re Sen Reg S 17/16.03.23	EUR	2 600 000.00	98.33	2 556 554.00	2.31%
	DE000A2LQRA1	RAG-Stiftung 0% Conv Evonilnd Re Sen Reg S 18/02.10.24	EUR	1 300 000.00	95.36	1 239 712.50	1.12%

Autres titres de créance						902 315.71	0.82%
	FR0013318102	Elis SA 2.875% EMTN Sen 18/15.02.26	EUR	900 000.00	97.72	902 315.71	0.82%
Creances issues de prises en pension						-3 799 940.28	-3.43%
		XS1254584599 201219	EUR	(899 200.00)	-	-898 922.02	-0.81%
		DE000A2G87D4 161019	EUR	(1 960 000.00)	-	-1 956 580.83	-1.77%
		XS1351586588 161119	EUR	(441 040.00)	-	-440 108.12	-0.40%
		XS1321004118 130819	EUR	(506 750.00)	-	-504 329.31	-0.46%
Options						21 902.00	0.02%
		Total SA CALL 12/20 MONEP 60	EUR	233.00	0.94	21 902.00	0.02%
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé						252 700.00	0.23%
	LU1673108939	Aroundtown SA Bearer	EUR	35 000.00	7.22	252 700.00	0.23%
UCITS						7 853 703.00	7.10%
	FR0010680157	Oddo BHF Jour CI EUR Cap	EUR	3 300.00	2 379.91	7 853 703.00	7.10%
Actif Net						110 675 174.98	100.00%

ODDO BHF EUROPEAN CONVERTIBLES MODERATE

Securities Financing Transactions Regulation

31/12/2018

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			3 737 937.64		
% de l'actif net total			3.37%		

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	3 601 111.01				
% des actifs pouvant être prêtés	3.78%				

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		ODDO		
Montant	3 601 111.01		3 737 937.64		
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	3 821 244.06		3 799 940.28		
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					

Echéance 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	3 601 111.01		3 737 937.64		

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	7 621 184.34
Montant conservé	Odde et Cie

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 ventilés

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
OPC					
Montant	43 615.23		27 264.87	436.37	
en % des revenus	11.05%		6.91%	0.11%	
Gestionnaire					
Montant					
en % des revenus					
Tiers (ex. agent prêteur...)					
Montant					
en % des revenus					

Données sur les coûts ventilés

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
OPC					
Montant			497.07	513.77	
Gestionnaire					
Montant					
Tiers (ex. agent prêteur...)					
Montant					