



Dati semestrali al 30 giugno 2020

ODDO BHF HAUT RENDEMENT 2023

Fondo comune di investimento di diritto francese

IL DOCUMENTO DI INFORMAZIONE SEMESTRALE NON È OGGETTO DI CERTIFICAZIONE DA PARTE DEL REVISORE DEI CONTI DELL'OICVM

STATO PATRIMONIALE

Elementi dello stato patrimoniale	Importo alla data di chiusura periodica*
a) Attività finanziarie idonee di cui al 1° capoverso della lettera l dell'articolo L. 214-24-55 del Code monétaire et financier	380.416.007,34
b) Disponibilità presso banche	11.478.209,38
c) Altre attività detenute dal FIA	70.440.613,78
d) Totale delle attività detenute dal FIA	462.334.830,50
e) Passivo	-63.495.545,06
f) Valore patrimoniale netto	398.839.285,44

* Gli importi hanno segno positivo o negativo

NUMERO DI QUOTE O AZIONI IN CIRCOLAZIONE E VALORE PATRIMONIALE NETTO

Classe	Tipologia di quote	Patrimonio netto per quota	Numero di quote in circolazione	Valore patrimoniale netto
CR-EUR	Capitalizzazione	170.856.057,85	1.751.061,578	97,57
CI-EUR	Capitalizzazione	99.472.073,12	99.890,778	995,80
GC-EUR	Capitalizzazione	47.791.601,66	484.232,308	98,69
CN-CHF (H)	Capitalizzazione	10.425.662,65	115.331,349	90,39
CN-USD (H)	Capitalizzazione	205.160,93	2.298,568	89,25
CN-EUR	Capitalizzazione	1.477.139,88	15.947,695	92,62
DR-EUR	Distribuzione	41.127.729,13	465.771,124	88,30
DI-EUR	Distribuzione	27.483.860,22	30.449,377	902,60

PROSPETTO DI COMPOSIZIONE DEL PORTAFOGLIO TITOLI

Elementi del portafoglio titoli:	Percentuale	
	Patrimonio netto	Patrimonio totale
a) Attività finanziarie idonee e strumenti del mercato monetario ammessi alla negoziazione in un mercato regolamentato ai sensi dell'articolo L. 422-1 del Code monétaire et financier	92,75	80,00
b) Attività finanziarie idonee e strumenti del mercato monetario ammessi alla negoziazione in un altro mercato regolamentato, regolarmente funzionante, riconosciuto e aperto al pubblico, con sede in uno Stato membro dell'Unione europea o in un altro Stato che faccia parte dell'accordo sullo Spazio economico europeo	0,00	0,00
c) Attività finanziarie idonee e strumenti del mercato monetario ammessi alla quotazione ufficiale di una borsa valori di un paese terzo o negoziati su un altro mercato di uno Stato terzo, regolamentato, regolarmente funzionante, riconosciuto e aperto al pubblico, purché tale borsa valori o tale mercato non figurino su una lista predisposta dall'Autorité des marchés financiers e a condizione che la scelta della borsa o del mercato sia prevista dalla legge, dal regolamento o dallo statuto dell'organismo di investimento collettivo in valori mobiliari	1,88	1,63
d) Attività finanziarie di nuova emissione di cui al 4° capoverso della lettera I dell'articolo R. 214-11 del Code monétaire et financier;	0,00	0,00
e) Altre attività: altre attività di cui alla lettera II dell'articolo R. 214-11 del Code monétaire et financier	2,24	1,93

RIPARTIZIONE DEL PATRIMONIO PER VALUTA

Titoli	Valuta	Importo (EUR)	Percentuale	
			Patrimonio netto	Patrimonio totale
United Group BV 4.875% Reg S 17/01.07.24	EUR	11.997.468,31	3,01	2,59
IPD 3 BV 4.5% EMTN Sen Reg S 17/15.07.22	EUR	9.947.028,00	2,49	2,15
Spie SAS 3.125% Sen 17/22.03.24	EUR	9.642.843,62	2,42	2,09
Cott Finance Corp 5.5% EMTN Reg S Sen 16/01.07.24	EUR	9.622.010,67	2,41	2,08
Hanesbrands Fin Luxembourg SCA 3.5% Reg S Sen 16/15.06.24	EUR	9.275.566,83	2,33	2,01
PrestigeBidCo GmbH 6.25% Reg S Sen 16/15.12.23	EUR	7.762.072,69	1,95	1,68
Rexel SA 2.625% EMTN Sen Reg S 17/15.06.24	EUR	7.736.148,11	1,94	1,67
Cemex Finance LLC 4.625% Reg S Sen 16/15.06.24	EUR	7.712.671,42	1,93	1,67
PPF Telecom Group BV 3.5% EMTN Ser 3 Tr 2 Sen 20/20.05.24	EUR	7.551.502,33	1,89	1,63
Energo-Pro AS 4% Sen Reg S 17/07.12.22	EUR	7.536.161,25	1,89	1,63
Nemak SAB de CV 3.25% Sen Reg S 17/15.03.24	EUR	7.451.975,21	1,87	1,61
Grupo Antolin Irausa SA 3.25% Sen Reg S 17/30.04.24	EUR	7.238.590,19	1,81	1,57
3AB Optique Dev SAS 4% Sen Reg S 17/01.10.23	EUR	6.803.657,78	1,71	1,47
Teva Pharmaceutical Fin II BV 1.25% 15/31.03.23	EUR	6.524.104,52	1,64	1,41
Intl Game Technology Plc 4.75% Reg S Sen 15/15.02.23	EUR	6.450.106,25	1,62	1,40
Loxam 4.25% Sen Reg S 17/15.04.24	EUR	6.163.849,44	1,55	1,33
ContourGlobal Power Hgs SA 3.375% Sen Reg S 18/01.08.23	EUR	6.043.093,81	1,52	1,31
LKQ Italia Bondco SpA 3.875% Reg S Sen 16/01.04.24	EUR	5.836.684,78	1,46	1,26
Burger King France SAS 6% Sen Reg S 17/01.05.24	EUR	5.747.234,00	1,44	1,24
ThyssenKrupp AG 2.875% EMTN Sen Reg S 19/22.02.24	EUR	5.670.583,36	1,42	1,23
Gamenet Group SpA FRN Reg S Sen 18/27.04.23	EUR	5.615.937,00	1,41	1,21
Parts Europe SA FRN Reg S Sen 16/01.05.22	EUR	5.472.446,05	1,37	1,18
Platin 1425 GmbH 5.375% Sen Reg S 17/15.06.23	EUR	5.416.036,44	1,36	1,17
Algeco Global Fin Plc 6.5% Sen Reg S 18/15.02.23	EUR	5.359.679,13	1,34	1,16
Motor Oil Finance Plc 3.25% Sen Reg S 17/01.04.22	EUR	5.175.251,92	1,30	1,12
Equinix Inc 2.875% Sen 18/15.03.24	EUR	5.072.438,94	1,27	1,10
Saipem Finance Intl BV 3.75% EMTN Reg S Sen 16/08.09.23	EUR	5.057.485,38	1,27	1,09
DKT Finance ApS 7% Sen Reg S 18/17.06.23	EUR	4.988.502,19	1,25	1,08
Casino Guichard Perrachon VAR EMTN Step-up Sen 14/07.03.24	EUR	4.837.194,71	1,21	1,05
Fnac Darty SA 1.875% Sen Reg S 19/30.05.24	EUR	4.802.160,40	1,20	1,04
Jaguar Land Rover Automoti Plc 2.2% Reg S Sen 17/15.01.24	EUR	4.770.325,53	1,20	1,03
EG Global Finance PLC 3.625% Sen Reg S 19/07.02.24	EUR	4.655.844,23	1,17	1,01
Adler Pelzer Holding GmbH 4.125% Sen Reg S 17/01.04.24	EUR	4.609.202,37	1,16	1,00
Oci NV 5% Sen Reg S 18/15.04.23	EUR	4.534.884,29	1,14	0,98
Crown European Hgs SA 0.75% Sen Reg S 19/15.02.23	EUR	4.124.215,71	1,03	0,89
Picard Groupe FRN Sen Reg S 17/30.11.23	EUR	4.079.121,67	1,02	0,88
Nexans SA 2.75% Sen 17/05.04.24	EUR	4.035.080,55	1,01	0,87

Titoli	Valuta	Importo (EUR)	Percentuale	
			Patrimonio netto	Patrimonio totale
Novem Group GmbH FRN Sen Reg S 19/15.05.24	EUR	3.875.893,38	0,97	0,84
Playtech Plc 3.75% Sen Reg S 18/12.10.23	EUR	3.683.583,48	0,92	0,80
Almaviva Italian Inno Co SpA 7.25% Sen Reg S 17/15.10.22	EUR	3.647.905,66	0,91	0,79
VZ Vendor Financing BV 2.5% Sen Reg S 19/31.01.24	EUR	3.633.722,72	0,91	0,79
Volvo Car AB 2.125% EMTN Sen Reg S 19/02.04.24	EUR	3.612.461,41	0,91	0,78
Dometic Group AB 3% EMTN Sen Reg S 18/13.09.23	EUR	3.611.075,02	0,91	0,78
Titan Global Finance Plc 3.5% Reg S Sen 16/17.06.21	EUR	3.539.495,49	0,89	0,77
Telecom Italia SpA 4% EMTN Sen Reg S 19/11.04.24	EUR	3.523.776,16	0,88	0,76
Cirsa Finance Intl Sàrl 6.25% Sen Reg S 18/20.12.23	EUR	3.516.770,83	0,88	0,76
Sisal Group SpA 7% Reg S Sen 16/31.07.23	EUR	3.482.811,06	0,87	0,75
Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% EMTN Reg S 16/29.03.24	EUR	3.467.384,92	0,87	0,75
Radisson Hotel Hgs AB 6.875% Sen Reg S 18/15.07.23	EUR	3.439.542,84	0,86	0,74
Adler Real Estate AG 1.875% Sen Reg S 18/27.04.23	EUR	3.396.121,44	0,85	0,73
El Corte Ingles SA 3% Sen Reg S 18/15.03.24	EUR	3.381.446,62	0,85	0,73
Manutencoop Facility Mgt SpA 9% Sen Reg S 17/15.06.22	EUR	3.355.332,00	0,84	0,73
Norican A/S 4.5% Sen Reg S 17/15.05.23	EUR	3.327.433,00	0,83	0,72
SIG Combibloc PurchaseCo Sàrl 1.875% Sen Reg S 20/18.06.23	EUR	3.255.581,33	0,82	0,70
Elis SA 1.875% EMTN Sen 18/15.02.23	EUR	3.241.159,91	0,81	0,70
Guala Closures SpA FRN Sen Reg S 18/15.04.24	EUR	3.076.664,73	0,77	0,67
Getlink SE 3.625% Sen Reg S 18/01.10.23	EUR	3.037.834,17	0,76	0,66
Petroleos Mexicanos 5.125% EMTN Ser C Sen Reg S 16/15.03.23	EUR	2.983.304,38	0,75	0,65
Gobalworth Real Estate Invs Ltd 2.875% Sen Reg S 17/20.06.22	EUR	2.900.943,10	0,73	0,63
Elis SA 1.75% EMTN Sen 19/11.04.24	EUR	2.791.341,37	0,70	0,60
Huntsman Intl LLC 5.125% Sen 14/15.04.21	EUR	2.729.249,67	0,68	0,59
ZF North America Capital Inc 2.75% Reg S Sen 15/27.04.23	EUR	2.691.637,03	0,67	0,58
Bausch Health Co Inc 4.5% Reg S Sen 15/15.05.23	EUR	2.686.837,50	0,67	0,58
Telecom Italia SpA 2.5% EMTN Reg S Sen 17/19.07.23	EUR	2.651.588,93	0,66	0,57
La Financiere Atalian SA 4% Sen Reg S 17/15.05.24	EUR	2.635.693,56	0,66	0,57
Petrobras Global Finance BV 4.25% Reg S Ser 2023 12/02.10.23	EUR	2.599.050,50	0,65	0,56
Tenneco Inc 4.875% Sen Reg S 17/15.04.22	EUR	2.572.903,12	0,65	0,56
Quatrim SA 5.875% Sen Reg S 19/15.01.24	EUR	2.513.209,06	0,63	0,54
3AB Optique Dev SAS FRN Sen Reg S 17/01.10.23	EUR	2.445.399,38	0,61	0,53
Autostrade per l'Italia SpA 5.875% EMTN ser 104/09.06.24	EUR	2.421.852,52	0,61	0,52
Sappi Papier Holdings GmbH 4% Reg S Sen 16/01.04.23	EUR	2.289.177,78	0,57	0,50
Autostrade per l'Italia SpA 2.875% EMTN Ser 14 13/26.02.21	EUR	2.241.756,21	0,56	0,48
Consus Real Estate AG 9.625% Sen Secured Reg S 19/15.05.24	EUR	2.085.527,35	0,52	0,45
Orano SA 3.125% EMTN 14/20.03.23	EUR	2.040.068,22	0,51	0,44
Groupe Ecore Holding SAS FRN Sen Reg S	EUR	1.969.998,33	0,49	0,43

Titoli	Valuta	Importo (EUR)	Percentuale	
			Patrimonio netto	Patrimonio totale
18/15.11.23				
Ball Corp 0.875% Sen 19/15.03.24	EUR	1.774.952,49	0,45	0,38
CBR Fashion Holding GmbH 5.125% Sen Reg S 17/01.10.22	EUR	1.731.869,72	0,43	0,37
Constellium SE 4.625% EMTN Reg S Sen 14/15.05.21	EUR	1.122.750,71	0,28	0,24
PPF Telecom Group BV 3.5% EMTN Sen Reg S 20/20.05.24	EUR	894.200,38	0,22	0,19
TOTALE	EUR	355.198.466,56	89,06	76,82
William Hill Plc 4.875% Reg S Sen 16/07.09.23	GBP	8.271.476,75	2,07	1,79
Premier Foods Finance Plc 6.25% Sen Reg S 18/15.10.23	GBP	6.035.370,73	1,51	1,31
Wagamama Finance Plc 4.125% Sen Reg S 17/01.07.22	GBP	4.041.248,91	1,01	0,87
TOTALE	GBP	18.348.096,39	4,60	3,97
Chemours (The) Co 6.625% Sen 16/15.05.23	USD	3.868.951,69	0,97	0,84
TOTALE	USD	3.868.951,69	0,97	0,84
TOTALE		377.415.514,64	94,63	81,63

RIPARTIZIONE DEL PATRIMONIO PER SETTORE ECONOMICO

Settore di attività	Percentuale	
	Patrimonio netto	Patrimonio totale
Parti di ricambio e attrezzature per automezzi	9,01	7,75
Società finanziarie plurisettoriali	6,95	6,00
Altri servizi finanziari	5,99	5,17
Casinò e case da gioco	5,97	5,15
Consulenza giuridica e contabile	4,56	3,93
Componenti e apparecchiature elettriche	3,86	3,33
Altri settori	58,29	50,30
TOTALE	94,63	81,63

RIPARTIZIONE DEL PATRIMONIO PER PAESE DI RESIDENZA

Paese	Percentuale	
	Patrimonio netto	Patrimonio totale
FRANCIA	20,89	17,98
PAESI BASSI	14,09	12,16
REGNO UNITO	10,81	9,33
Altri paesi	48,84	42,16
TOTALE	94,63	81,63

MOVIMENTI DEL PORTAFOGLIO TITOLI NEL CORSO DEL PERIODO

Elementi del portafoglio titoli	Movimenti (importo)	
	Acquisizioni	Cessioni
a) Attività finanziarie idonee e strumenti del mercato monetario ammessi alla negoziazione in un mercato regolamentato ai sensi dell'articolo L. 422-1 del Code monétaire et financier	56.469.031,92	204.459.459,58
b) Attività finanziarie idonee e strumenti del mercato monetario ammessi alla negoziazione in un altro mercato regolamentato, regolarmente funzionante, riconosciuto e aperto al pubblico, con sede in uno Stato membro dell'Unione europea o in un altro Stato che faccia parte dell'accordo sullo Spazio economico europeo	0,00	0,00
c) Attività finanziarie idonee e strumenti del mercato monetario ammessi alla quotazione ufficiale di una borsa valori di un paese terzo o negoziati su un altro mercato di uno Stato terzo, regolamentato, regolarmente funzionante, riconosciuto e aperto al pubblico, purché tale borsa valori o tale mercato non figurino su una lista predisposta dall'Autorité des marchés financiers e a condizione che la scelta della borsa o del mercato sia prevista dalla legge, dal regolamento o dallo statuto dell'organismo di investimento collettivo in valori mobiliari	5.532.132,68	2.715.300,37
d) Attività finanziarie di nuova emissione di cui al 4° capoverso della lettera I dell'articolo R. 214-11 del Code monétaire et financier;	0,00	0,00
e) Altre attività: altre attività di cui alla lettera II dell'articolo R. 214-11 del Code monétaire et financier	53.018.697,45	46.246.956,75

Movimenti verificatisi nel corso del periodo	Movimenti (importo)
Acquisizioni	115.019.862,05
Cessioni	253.421.716,70

DISTRIBUZIONE NEL CORSO DEL PERIODO

	Classe €	Importo netto unitario €	Credito d'imposta €	Importo lordo unitario €
Distribuzione dei risultati				
Versato				
20/04/2020	D1 CLASSE DR-EUR	2,95		2,95
	D2 CLASSE DI-EUR	30,10		30,10
Da versare				
	D1 CLASSE DR-EUR			
	D2 CLASSE DI-EUR			
Distribuzione delle plusvalenze e minusvalenze nette				
Versate				
Da versare				
	D1 CLASSE DR-EUR			
	D2 CLASSE DI-EUR			

PATRIMONIO

Denominazione dei titoli	Valuta	Qtà Num o nominale	Valore di mercato	% del patrimonio netto
Nemak SAB de CV 3.25% Sen Reg S 17/15.03.24	EUR	7.814.000	7.451.975,21	1,87
Getlink SE 3.625% Sen Reg S 18/01.10.23	EUR	3.000.000	3.037.834,17	0,76
Groupe Ecore Holding SAS FRN Sen Reg S 18/15.11.23	EUR	3.100.000	1.969.998,33	0,49
Petrobras Global Finance BV 4.25% Reg S Ser 2023 12/02.10.23	EUR	2.450.000	2.599.050,50	0,65
Huntsman Intl LLC 5.125% Sen 14/15.04.21	EUR	2.674.000	2.729.249,67	0,68
Bausch Health Co Inc 4.5% Reg S Sen 15/15.05.23	EUR	2.700.000	2.686.837,50	0,67
Teva Pharmaceutical Fin II BV 1.25% 15/31.03.23	EUR	7.000.000	6.524.104,52	1,64
Intl Game Technology Plc 4.75% Reg S Sen 15/15.02.23	EUR	6.300.000	6.450.106,25	1,62
ZF North America Capital Inc 2.75% Reg S Sen 15/27.04.23	EUR	2.700.000	2.691.637,03	0,67
Sappi Papier Holdings GmbH 4% Reg S Sen 16/01.04.23	EUR	2.500.000	2.289.177,78	0,57
Chemours (The) Co 6.625% Sen 16/15.05.23	USD	4.500.000	3.868.951,69	0,97
LKQ Italia Bondco SpA 3.875% Reg S Sen 16/01.04.24	EUR	5.600.000	5.836.684,78	1,46
Hanesbrands Fin Luxembourg SCA 3.5% Reg S Sen 16/15.06.24	EUR	9.300.000	9.275.566,83	2,33
William Hill Plc 4.875% Reg S Sen 16/07.09.23	GBP	7.300.000	8.271.476,75	2,07
Cemex Finance LLC 4.625% Reg S Sen 16/15.06.24	EUR	7.800.000	7.712.671,42	1,93
Titan Global Finance Plc 3.5% Reg S Sen 16/17.06.21	EUR	3.500.000	3.539.495,49	0,89
Sisal Group SpA 7% Reg S Sen 16/31.07.23	EUR	3.403.125	3.482.811,06	0,87
Parts Europe SA FRN Reg S Sen 16/01.05.22	EUR	5.648.034,95	5.472.446,05	1,37
PrestigeBidCo GmbH 6.25% Reg S Sen 16/15.12.23	EUR	7.700.000	7.762.072,69	1,95
Jaguar Land Rover Automoti Plc 2.2% Reg S Sen 17/15.01.24	EUR	5.797.000	4.770.325,53	1,20
Spie SAS 3.125% Sen 17/22.03.24	EUR	9.600.000	9.642.843,62	2,42
Tenneco Inc 4.875% Sen Reg S 17/15.04.22	EUR	2.700.000	2.572.903,12	0,65
Adler Pelzer Holding GmbH 4.125% Sen Reg S 17/01.04.24	EUR	6.329.000	4.609.202,37	1,16
Nexans SA 2.75% Sen 17/05.04.24	EUR	4.000.000	4.035.080,55	1,01
Loxam 4.25% Sen Reg S 17/15.04.24	EUR	6.366.000	6.163.849,44	1,55
Motor Oil Finance Plc 3.25% Sen Reg S 17/01.04.22	EUR	5.100.000	5.175.251,92	1,30
Grupo Antolin Irausa SA 3.25% Sen Reg S 17/30.04.24	EUR	8.256.000	7.238.590,19	1,81
Burger King France SAS 6% Sen Reg S 17/01.05.24	EUR	5.700.000	5.747.234,00	1,44
La Financiere Atalian SA 4% Sen Reg S 17/15.05.24	EUR	3.512.000	2.635.693,56	0,66
Norican A/S 4.5% Sen Reg S 17/15.05.23	EUR	4.600.000	3.327.433,00	0,83
Gobalworth Real Estate Invs Ltd 2.875% Sen Reg S 17/20.06.22	EUR	2.900.000	2.900.943,10	0,73
Wagamama Finance Plc 4.125% Sen Reg S 17/01.07.22	GBP	4.123.000	4.041.248,91	1,01
Manutencoop Facility Mgt SpA 9% Sen Reg S 17/15.06.22	EUR	3.450.000	3.355.332,00	0,84
United Group BV 4.875% Reg S 17/01.07.24	EUR	11.850.000	11.997.468,31	3,04
Almaviva Italian Inno Co SpA 7.25% Sen Reg S 17/15.10.22	EUR	4.040.000	3.647.905,66	0,91
3AB Optique Dev SAS 4% Sen Reg S 17/01.10.23	EUR	7.000.000	6.803.657,78	1,71
3AB Optique Dev SAS FRN Sen Reg S 17/01.10.23	EUR	2.545.714,3128	2.445.399,38	0,61
CBR Fashion Holding GmbH 5.125% Sen Reg S 17/01.10.22	EUR	2.000.000	1.731.869,72	0,43
Energo-Pro AS 4% Sen Reg S 17/07.12.22	EUR	7.700.000	7.536.161,25	1,89
Picard Groupe FRN Sen Reg S 17/30.11.23	EUR	4.250.000	4.079.121,67	1,02
Platin 1425 GmbH 5.375% Sen Reg S 17/15.06.23	EUR	5.850.000	5.416.036,44	1,36
Algeco Global Fin Plc 6.5% Sen Reg S 18/15.02.23	EUR	5.454.000	5.359.679,13	1,34
Equinix Inc 2.875% Sen 18/15.03.24	EUR	4.950.000	5.072.438,94	1,27
Oci NV 5% Sen Reg S 18/15.04.23	EUR	4.462.000	4.534.884,29	1,14
Gamenet Group SpA FRN Reg S Sen 18/27.04.23	EUR	5.800.000	5.615.937,00	1,41
Adler Real Estate AG 1.875% Sen Reg S 18/27.04.23	EUR	3.500.000	3.396.121,44	0,85
Premier Foods Finance Plc 6.25% Sen Reg S 18/15.10.23	GBP	5.261.000	6.035.370,73	1,51

Denominazione dei titoli	Valuta	Qtà Num o nominale	Valore di mercato	% del patrimonio netto
DKT Finance ApS 7% Sen Reg S 18/17.06.23	EUR	5.008.000	4.988.502,19	1,25
Cirsa Finance Intl Sàrl 6.25% Sen Reg S 18/20.12.23	EUR	3.900.000	3.516.770,83	0,88
Radisson Hotel Hgs AB 6.875% Sen Reg S 18/15.07.23	EUR	3.490.000	3.439.542,84	0,86
ContourGlobal Power Hgs SA 3.375% Sen Reg S 18/01.08.23	EUR	5.908.000	6.043.093,81	1,52
Guala Closures SpA FRN Sen Reg S 18/15.04.24	EUR	3.115.000	3.076.664,73	0,77
El Corte Ingles SA 3% Sen Reg S 18/15.03.24	EUR	3.437.000	3.381.446,62	0,85
Playtech Plc 3.75% Sen Reg S 18/12.10.23	EUR	3.715.000	3.683.583,48	0,92
Fnac Darty SA 1.875% Sen Reg S 19/30.05.24	EUR	4.929.000	4.802.160,40	1,20
EG Global Finance PLC 3.625% Sen Reg S 19/07.02.24	EUR	4.860.000	4.655.844,23	1,17
Consus Real Estate AG 9.625% Sen Secured Reg S 19/15.05.24	EUR	1.900.000	2.085.527,35	0,52
Novem Group GmbH FRN Sen Reg S 19/15.05.24	EUR	4.167.000	3.875.893,38	0,97
Crown European Hgs SA 0.75% Sen Reg S 19/15.02.23	EUR	4.266.000	4.124.215,71	1,03
VZ Vendor Financing BV 2.5% Sen Reg S 19/31.01.24	EUR	3.700.000	3.633.722,72	0,91
Quatrim SA 5.875% Sen Reg S 19/15.01.24	EUR	2.442.000	2.513.209,06	0,63
Ball Corp 0.875% Sen 19/15.03.24	EUR	1.850.000	1.774.952,49	0,45
SIG Combibloc PurchaseCo Sàrl 1.875% Sen Reg S 20/18.06.23	EUR	3.200.000	3.255.581,33	0,82
TOTALE Obbligazioni e titoli assimilati negoziati su un mercato regolamentato o assimilato			292.390.841,94	73,31
TOTALE Obbligazioni e titoli assimilati			292.390.841,94	73,31
Veolia Environnement 0% BTr 20/13.07.20	EUR	3.000.000	3.000.492,70	0,75
TOTALE Titoli di debito non negoziati su un mercato regolamentato o assimilato			3.000.492,70	0,75
Casino Guichard Perrachon VAR EMTN Step-up Sen 14/07.03.24	EUR	5.300.000	4.837.194,71	1,21
Elis SA 1.75% EMTN Sen 19/11.04.24	EUR	2.900.000	2.791.341,37	0,70
Autostrade per l'Italia SpA 5.875% EMTN ser 104/09.06.24	EUR	2.200.000	2.421.852,52	0,61
Autostrade per l'Italia SpA 2.875% EMTN Ser 14 13/26.02.21	EUR	2.250.000	2.241.756,21	0,56
Orano SA 3.125% EMTN 14/20.03.23	EUR	2.000.000	2.040.068,22	0,51
Constellium SE 4.625% EMTN Reg S Sen 14/15.05.21	EUR	1.117.333,66	1.122.750,71	0,28
Petroleos Mexicanos 5.125% EMTN Ser C Sen Reg S 16/15.03.23	EUR	3.000.000	2.983.304,38	0,75
Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% EMTN Reg S 16/29.03.24	EUR	3.350.000	3.467.384,92	0,87
Cott Finance Corp 5.5% EMTN Reg S Sen 16/01.07.24	EUR	9.600.000	9.622.010,67	2,41
Saipem Finance Intl BV 3.75% EMTN Reg S Sen 16/08.09.23	EUR	4.800.000	5.057.485,38	1,27
Telecom Italia SpA 2.5% EMTN Reg S Sen 17/19.07.23	EUR	2.550.000	2.651.588,93	0,66
Rexel SA 2.625% EMTN Sen Reg S 17/15.06.24	EUR	7.791.000	7.736.148,11	1,94
IPD 3 BV 4.5% EMTN Sen Reg S 17/15.07.22	EUR	10.400.000	9.947.028,00	2,51
Elis SA 1.875% EMTN Sen 18/15.02.23	EUR	3.300.000	3.241.159,91	0,81
Dometic Group AB 3% EMTN Sen Reg S 18/13.09.23	EUR	3.600.000	3.611.075,02	0,91
Telecom Italia SpA 4% EMTN Sen Reg S 19/11.04.24	EUR	3.347.000	3.523.776,16	0,88
ThyssenKrupp AG 2.875% EMTN Sen Reg S 19/22.02.24	EUR	5.840.000	5.670.583,36	1,42
Volvo Car AB 2.125% EMTN Sen Reg S 19/02.04.24	EUR	3.673.000	3.612.461,41	0,91
PPF Telecom Group BV 3.5% EMTN Sen Reg S 20/20.05.24	EUR	875.000	894.200,38	0,22
PPF Telecom Group BV 3.5% EMTN Ser 3 Tr 2 Sen 20/20.05.24	EUR	7.400.000	7.551.502,33	1,89
TOTALE Altri titoli di debito			85.024.672,70	21,32
TOTALE Titoli di debito			88.025.165,40	22,07
Oddo BHF Jour CI EUR Cap	EUR	2.500	5.926.875,00	1,49
TOTALE OICVM e FIA a vocazione generale			5.926.875,00	1,49
TOTALE Fondi d'investimento a vocazione generale riservati a non professionisti ed equivalenti di altri Stati membri dell'UE			5.926.875,00	1,49
TOTALE Titoli di OICR			5.926.875,00	1,49
XS1987729412 090621	EUR	204.000	214,20	0,00
TOTALE Operazioni temporanee su titoli			214,20	0,00

Denominazione dei titoli	Valuta	Qtà Num o nominale	Valore di mercato	% del patrimonio netto
TOTALE Crediti rappresentativi di titoli dati in prestito			214,20	0,00
XS1987729412 160421	EUR	-537.350	-534.890,50	-0,13
XS1878856803 160421	EUR	-1.840.000	-1.832.613,17	-0,46
XS1811351821 140521	EUR	-1.548.600	-1.545.753,33	-0,39
FR0013318094 040621	EUR	-200.000	-199.872,80	-0,05
XS1735583095 090621	EUR	-542.493	-542.173,23	-0,14
XS1600514696 090621	EUR	-1.057.838,4	-1.057.391,17	-0,27
XS1987729412 080621	EUR	-1.926.549	-1.924.008,26	-0,48
XS1551347393 220621	EUR	-726.825	-726.484,24	-0,18
XS2189592889 300621	EUR	-609.420	-609.420,00	-0,15
XS1590066624 300621	EUR	-758.540	-758.540,00	-0,19
TOTALE Operazioni temporanee su titoli			-9.731.146,70	-2,44
TOTALE Debiti rappresentativi di titoli ceduti in pronti contro termine			-9.731.146,70	-2,44
TOTALE Operazioni temporanee su titoli			-9.730.932,50	-2,44
Getlink SE 3.625% Sen Reg S 18/01.10.23	EUR	3.000	54.375,00	0,01
Cott Finance Corp 5.5% EMTN Reg S Sen 16/01.07.24	EUR	9.600	264.000,00	0,07
Wagamama Finance Plc 4.125% Sen Reg S 17/01.07.22	GBP	4.123	93.541,70	0,02
3AB Optique Dev SAS FRN Sen Reg S 17/01.10.23	EUR	2.700,0000369091	26.544,38	0,01
Picard Groupe FRN Sen Reg S 17/30.11.23	EUR	4.250	32.229,17	0,01
Ball Corp 0.875% Sen 19/15.03.24	EUR	1.850	10.029,21	0,00
TOTALE Cedole e dividendi			480.719,46	0,12
CPTN EONIA 0.00 0906	EUR	-214.200	-214.142,42	-0,05
CPTN EONIA 0.00 2506	EUR	0	4,20	0,00
TOTALE Deposito			-214.138,22	-0,05
Creditori vari S/R EUR	EUR	-162.395,26	-162.395,26	-0,04
Creditori vari deposito a termine EUR	EUR	-322.003,87	-322.003,87	-0,08
Altri creditori vari GBP	GBP	-110.000	-121.001,47	-0,03
Debitori vari EUR	EUR	1.368.017,5	1.368.017,50	0,34
Altri debitori vari EUR	EUR	120.221,21	120.221,21	0,03
TOTALE Altri debiti e crediti			882.838,11	0,22
Totale Debiti e crediti			1.149.419,35	0,29
OddoCie - CHF	CHF	-26.193,18	-24.614,19	-0,01
OddoCie - EUR	EUR	11.423.272,25	11.423.272,25	2,87
OddoCie - GBP	GBP	45.803,53	50.384,49	0,01
OddoCie - USD	USD	5.080,27	4.522,43	0,00
OddoCie - EUR	EUR	30,21	30,21	0,00
TOTALE Attività			11.453.595,19	2,87
V/A GBP EUR 140820	EUR	28.127.176,61	28.127.176,61	7,05
V/A GBP EUR 140820	GBP	-25.320.000	-27.833.627,86	-6,98
V/A USD EUR 140820	EUR	3.949.974,02	3.949.974,02	0,99
V/A USD EUR 140820	USD	-4.500.000	-4.002.141,16	-1,00
H A/V USD EUR 140820	EUR	351.000	312.167,01	0,08
H A/V USD EUR 140820	USD	-307.730,05	-307.730,05	-0,08
H A/V CHF EUR 140820	EUR	11.145.000	10.476.478,50	2,63
H A/V CHF EUR 140820	CHF	-10.441.960,55	-10.441.960,55	-2,62
H V/A USD EUR 140820	EUR	107.175,38	107.175,38	0,03
H V/A USD EUR 140820	USD	-120.420	-107.097,30	-0,03
A/V GBP EUR 140820	EUR	8.500.000	9.343.832,42	2,34
A/V GBP EUR 140820	GBP	-9.411.629,23	-9.411.629,23	-2,36

Denominazione dei titoli	Valuta	Qtà Num o nominale	Valore di mercato	% del patrimonio netto
TOTALE Operazioni a termine			212.617,79	0,05
TERM FIX 0.00 010720	EUR	10.057.788,52	10.057.788,52	2,52
TOTALE Depositi a termine			10.057.788,52	2,52
ADM OTC - SOGENE EUR	EUR	20.000	19.969,75	0,01
ADM OTC - NATIXI EUR	EUR	150.000	150.000,00	0,03
ADM OTC - CALYON EUR	EUR	-490.000	-489.839,51	-0,12
TOTALE Altre disponibilità			-319.869,76	-0,08
TOTALE Disponibilità			21.404.131,74	5,36
Commissione di gestione	CHF	-5.809,35	-5.459,15	0,00
Commissione di gestione	EUR	-317.596,04	-317.596,04	-0,08
Commissione di gestione	USD	-244,64	-217,78	0,00
Commissione di performance	EUR	-2.762,77	-2.762,77	0,00
Commissione di performance	USD	-13,83	-12,31	0,00
TOTALE Spese			-326.048,05	-0,08
TOTALE TESORERIA			22.227.503,04	5,57
TOTALE Posizioni detenute totalmente di proprietà			-167,44	0,00
TOTALE Operazioni contrattuali in vendita			-167,44	0,00
TOTALE Operazioni contrattuali			-167,44	0,00
TOTALE PATRIMONIO NETTO			398.839.285,44	100,00

ODDO BHF HAUT RENDEMENT 2023

Regolamento sulle operazioni di finanziamento tramite titoli

30/06/2020

EUR

Attività impegnate in ciascun tipo di operazioni di finanziamento tramite titoli e Total return swap in valore assoluto e in percentuale del patrimonio netto del fondo

	Operazioni di prestito titoli	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
Importo			9.915.853,88		
% del patrimonio netto totale			2,49		

Importo dei titoli e delle materie prime in prestito in proporzione alle attività

	Operazioni di prestito titoli	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
Importo delle attività in prestito	194.853,33				
% delle attività prestabili	0,05				

10 maggiori emittenti di garanzie reali ricevute (liquidità esclusa) per tutti i tipi di operazioni di finanziamento (volume di garanzie reali a titolo delle transazioni in corso)

1. Denominazione	
Volume delle garanzie reali ricevute	
2. Denominazione	
Volume delle garanzie reali ricevute	
3. Denominazione	
Volume delle garanzie reali ricevute	
4. Denominazione	
Volume delle garanzie reali ricevute	
5. Denominazione	
Volume delle garanzie reali ricevute	
6. Denominazione	
Volume delle garanzie reali ricevute	
7. Denominazione	
Volume delle garanzie reali ricevute	
8. Denominazione	
Volume delle garanzie reali ricevute	
9. Denominazione	
Volume delle garanzie reali ricevute	
10. Denominazione	
Volume delle garanzie reali ricevute	

10 principali controparti in valore assoluto delle attività e delle passività senza compensazione

	Operazioni di prestito titoli	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
1. Denominazione	ODDO BHF		ODDO BHF		
Importo	194.853,33		9.915.853,88		
Domicilio	FRANCIA		FRANCIA		
2. Denominazione					
Importo					
Domicilio					
3. Denominazione					

Importo				
Domicilio				
4. Denominazione				
Importo				
Domicilio				
5. Denominazione				
Importo				
Domicilio				
6. Denominazione				
Importo				
Domicilio				
7. Denominazione				
Importo				
Domicilio				
8. Denominazione				
Importo				
Domicilio				
9. Denominazione				
Importo				
Domicilio				
10. Denominazione				
Importo				
Domicilio				

Tipo e qualità delle garanzie reali (collaterale)

	Operazioni di prestito titoli	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
Tipo e qualità della garanzia reale					
Liquidità	214.138,22		9.731.146,70		
Strumenti di debito					
Rating di buona qualità					
Rating di qualità media					
Rating di bassa qualità					
Azioni					
Rating di buona qualità					
Rating di qualità media					
Rating di bassa qualità					
Quote di fondi					
Rating di buona qualità					
Rating di qualità media					
Rating di bassa qualità					
Valuta della garanzia					

Paese dell'emittente della garanzia reale _____

Scadenza della garanzia reale, classificata nelle seguenti categorie

	Operazioni di prestito titoli	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
meno di 1 giorno					
da 1 giorno a 1 settimana					
da 1 settimana a 1 mese					
da 1 a 3 mesi					
da 3 mesi a 1 anno					
oltre 1 anno					
scadenza aperta					

Scadenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e dei total return swap classificati nelle seguenti categorie

	Operazioni di prestito titoli	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
meno di 1 giorno					
da 1 giorno a 1 settimana					
da 1 settimana a 1 mese					
da 1 a 3 mesi					
da 3 mesi a 1 anno					
oltre 1 anno					
scadenza aperta	194.853,33		9.915.853,88		

Regolamento e compensazione dei contratti

	Operazioni di prestito titoli	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
Controparte centrale					
Bilaterali					
Trilaterali					

Dati sul riutilizzo delle garanzie reali

	Contante	Titoli
Importo massimo (%)		
Importo utilizzato (%)		
Rendimento derivante all'organismo d'investimento collettivo dal reinvestimento della garanzia reale in contante nell'ambito delle operazioni di finanziamento tramite titoli e total return swap		

Dati sulla custodia delle garanzie reali ricevute dall'organismo d'investimento collettivo

1. Denominazione	ODDO BHF
Importo custodito	9.945.284,92

Dati sulla custodia delle garanzie reali concesse dall'organismo d'investimento collettivo

Importo totale del collaterale versato

In % di tutte le garanzie reali versate

Conti separati

Conti collettivi

Altri conti

Dati concernenti la scomposizione del rendimento

		Operazioni di prestito titoli	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
OICR						
	Importo	10.465,55		50.716,93	272,68	
	in % dei rendimenti	0,10		0,49	0,00	
Gestore						
	Importo					
	in % dei rendimenti					
Terzi (es. agente mutuante, ecc.)						
	Importo					
	in % dei rendimenti					

Dati concernenti la scomposizione dei costi

		Operazioni di prestito titoli	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
OICR						
	Importo	12,68		115,82	1.057,07	
Gestore						
	Importo					
Terzi (es. agente mutuante, ecc.)						
	Importo					