



Dati semestrali al 30 settembre 2019

ODDO BHF HAUT RENDEMENT 2025

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 di cui al 1° capoverso della lettera l dell'articolo L. 214-20 del Code monétaire et financier | 979.261.013,00 |
| b) Disponibilità presso banche | 24.952.742,15 |
| c) Altre attività detenute dall'OICVM | 280.770.024,03 |
| d) Totale delle attività detenute dall'OICVM | 1.284.983.779,18 |
| e) Passivo | -227.042.870,54 |
| f) Valore patrimoniale netto | 1.057.940.908,64 |

* Gli importi hanno segno positivo o negativo

NUMERO DI QUOTE IN CIRCOLAZIONE E VALORE PATRIMONIALE NETTO PER QUOTA O AZIONE

| Classe | Tipologia di quote | Patrimonio netto per quota | Numero di quote in circolazione | Valore patrimoniale netto |
|--------------------|--------------------|----------------------------|---------------------------------|---------------------------|
| OddBHR25 CR C | C1 | 404.348.489,61 | 3.964.568,932 | 101,99 |
| OddBHR25 CI C | C2 | 272.205.339,28 | 264.683,696 | 1.028,41 |
| OddBHR25 CN C | C3 | 51.974.349,79 | 504.736,287 | 102,97 |
| OddBHR25 CR C | C4 | 3.175.336,31 | 34.245,130 | 92,72 |
| OddBHR25 CN C | C5 | 8.178.324,51 | 86.499,718 | 94,55 |
| OddBHR25 CN-USD C | C6 | 1.573.301,12 | 16.275,000 | 96,67 |
| OddBHR25 GC-EUR C | C7 | 127.906.334,96 | 1.285.265,871 | 99,51 |
| OddBHR25 DR-EUR Di | D1 | 73.128.282,17 | 736.147,947 | 99,33 |
| OddBHR25 DI Di | D2 | 112.831.186,66 | 113.061,061 | 997,96 |
| OddBHR25 EUR DN Di | D3 | 1.972.957,94 | 19.788,618 | 99,70 |
| OddBHR25 DR-USD Di | D4 | 647.006,29 | 7.000,000 | 92,42 |

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 | 89,87 | 73,99 |
| b) Attività finanziarie idonee e strumenti del mercato monetario ammessi alla negoziazione in un altro mercato regolamentato, regolarmente funzionante, riconosciuto e aperto al pubblico, i cui emittenti abbiano 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 | 0,33 | 0,27 |
| 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 | 5,86 | 4,82 |

RIPARTIZIONE DEL PATRIMONIO PER VALUTA

| Titoli | Valuta | Importo (EUR) | Percentuale | |
|----------------------|--------|---------------|------------------|-------------------|
| | | | Patrimonio netto | Patrimonio totale |
| PPFAren1 3.12 270326 | EUR | 18.488.281,30 | 1,75 | 1,44 |
| UnitedGr FRN 150525 | EUR | 15.333.160,60 | 1,45 | 1,19 |
| Spie 2.63 180626 | EUR | 15.184.403,41 | 1,44 | 1,18 |
| Rexel 2.75 150626 | EUR | 14.599.621,83 | 1,38 | 1,14 |
| Orano 3.37 230426 | EUR | 13.936.072,26 | 1,32 | 1,08 |
| EircoFin 3.5 150526 | EUR | 13.762.728,32 | 1,30 | 1,07 |
| CirFinIn 4.75 220525 | EUR | 13.026.530,61 | 1,23 | 1,01 |
| Rossini 6.75 301025 | EUR | 12.534.500,00 | 1,18 | 0,98 |
| AltiLux 6.25 150225 | EUR | 12.489.330,97 | 1,18 | 0,97 |
| Novafive 5 150625 | EUR | 11.799.116,89 | 1,12 | 0,92 |
| MatteTel 2.62 150924 | EUR | 11.641.806,20 | 1,10 | 0,91 |
| Constell 4.25 150226 | EUR | 11.620.463,58 | 1,10 | 0,90 |
| CodeFin2 6.75 011121 | EUR | 11.465.776,00 | 1,08 | 0,89 |
| EurMobGr 4 300426 | EUR | 11.372.099,11 | 1,07 | 0,89 |
| AlgGIFin 6.5 150223 | EUR | 11.122.426,61 | 1,05 | 0,87 |
| GestAuto 3.2 300426 | EUR | 11.075.640,00 | 1,05 | 0,86 |
| EDreaOdi 5.5 010923 | EUR | 11.013.940,10 | 1,04 | 0,86 |
| IHOVerwa 3.62 150525 | EUR | 10.695.121,95 | 1,01 | 0,83 |
| INEOSFin 2.87 010526 | EUR | 10.656.795,39 | 1,01 | 0,83 |
| Elis 2.87 150226 | EUR | 10.532.208,12 | 1,00 | 0,82 |
| FireBc FRN 300924 | EUR | 10.500.440,82 | 0,99 | 0,82 |
| SaipFinI 2.62 070125 | EUR | 10.471.926,93 | 0,99 | 0,81 |
| ConGIPOw 4.12 010825 | EUR | 10.065.903,57 | 0,95 | 0,78 |
| LKQEur 3.62 010426 | EUR | 10.062.268,63 | 0,95 | 0,78 |
| IntIGTec 3.5 150626 | EUR | 9.939.544,73 | 0,94 | 0,77 |
| ZiggoBd 4.62 150125 | EUR | 9.721.218,96 | 0,92 | 0,76 |
| SigmHold 5.75 150526 | EUR | 9.692.108,47 | 0,92 | 0,75 |
| PicaBond 5.5 301124 | EUR | 9.372.014,11 | 0,89 | 0,73 |
| EGGIFin 4.37 070225 | EUR | 9.348.089,95 | 0,88 | 0,73 |
| Diocle FRN 300626 | EUR | 9.294.914,98 | 0,88 | 0,72 |
| EnergoPr 4 071222 | EUR | 9.257.389,55 | 0,88 | 0,72 |
| KaefIsol 5.5 100124 | EUR | 9.153.036,11 | 0,87 | 0,71 |
| UnilSuHg 5.75 150525 | EUR | 9.044.389,43 | 0,85 | 0,70 |
| Chemours 4 150526 | EUR | 9.014.901,34 | 0,85 | 0,70 |
| Faurecia 3.12 150626 | EUR | 9.004.801,30 | 0,85 | 0,70 |
| GlwREInv 3 290325 | EUR | 9.002.453,86 | 0,85 | 0,70 |
| Playtech 4.25 070326 | EUR | 8.675.371,11 | 0,82 | 0,68 |
| SapPapHg 3.12 150426 | EUR | 8.528.880,95 | 0,81 | 0,66 |
| PaBFAFin 4.37 150526 | EUR | 8.456.527,03 | 0,80 | 0,66 |
| VirGrFin 4 150925 | EUR | 8.366.724,00 | 0,79 | 0,65 |
| Residomo 3.37 151024 | EUR | 8.340.079,38 | 0,79 | 0,65 |
| ManFaMgt 9 150622 | EUR | 8.333.454,00 | 0,79 | 0,65 |

| Titoli | Valuta | Importo (EUR) | Percentuale | |
|----------------------|--------|---------------|------------------|-------------------|
| | | | Patrimonio netto | Patrimonio totale |
| IntlGTec 3.5 150724 | EUR | 8.198.970,83 | 0,77 | 0,64 |
| AdiGHgs 3.5 150824 | EUR | 8.186.009,57 | 0,77 | 0,64 |
| KraPoCap 5.25 150526 | EUR | 8.181.160,66 | 0,77 | 0,64 |
| Plat1425 5.37 150623 | EUR | 8.171.789,62 | 0,77 | 0,64 |
| Norican 4.5 150523 | EUR | 7.994.110,00 | 0,76 | 0,62 |
| Victoria 5.25 150724 | EUR | 7.991.305,25 | 0,76 | 0,62 |
| CBRFasHg 5.12 011022 | EUR | 7.942.491,53 | 0,75 | 0,62 |
| AdlPelHg 4.12 010424 | EUR | 7.932.830,50 | 0,75 | 0,62 |
| Loxam 6 150425 | EUR | 7.748.232,00 | 0,73 | 0,60 |
| DometiGr 3 080526 | EUR | 7.687.541,62 | 0,73 | 0,60 |
| SelectGr 5.87 010224 | EUR | 7.566.660,26 | 0,72 | 0,59 |
| IntDesGr 6.5 151125 | EUR | 7.519.724,38 | 0,71 | 0,59 |
| Promo264 6.75 150823 | EUR | 7.462.144,55 | 0,71 | 0,58 |
| Telecolt 2.87 280126 | EUR | 7.460.548,20 | 0,71 | 0,58 |
| FnacDart 2.62 300526 | EUR | 7.430.808,94 | 0,70 | 0,58 |
| SwissFin 5.25 150824 | EUR | 7.415.686,85 | 0,70 | 0,58 |
| SmuKapAc 2.87 150126 | EUR | 7.414.699,31 | 0,70 | 0,58 |
| SamsFinc 3.5 150526 | EUR | 7.142.048,16 | 0,68 | 0,56 |
| MaxDiyHg 6.12 150722 | EUR | 7.127.625,47 | 0,67 | 0,55 |
| UGlIntl 3.25 011125 | EUR | 6.889.484,44 | 0,65 | 0,54 |
| SalImpr 1.75 261024 | EUR | 6.875.030,79 | 0,65 | 0,54 |
| 3ABOptiD 4 011023 | EUR | 6.850.081,33 | 0,65 | 0,53 |
| NovemGr FRN 150524 | EUR | 6.835.280,76 | 0,65 | 0,53 |
| ScienGam 3.37 150226 | EUR | 6.734.170,63 | 0,64 | 0,52 |
| InterxHg 4.75 150625 | EUR | 6.564.861,43 | 0,62 | 0,51 |
| Coty 4 150423 | EUR | 6.526.946,28 | 0,62 | 0,51 |
| Telecolt 3.62 250526 | EUR | 6.503.920,96 | 0,61 | 0,51 |
| Nordex 6.5 010223 | EUR | 6.265.103,33 | 0,59 | 0,49 |
| Telecolt 2.75 150425 | EUR | 6.241.302,90 | 0,59 | 0,49 |
| VerisMid 5.75 011223 | EUR | 6.236.278,69 | 0,59 | 0,49 |
| SarenFin 5.87 050222 | EUR | 6.200.418,71 | 0,59 | 0,48 |
| GruAntlr 3.25 300424 | EUR | 6.125.474,67 | 0,58 | 0,48 |
| ThyssenK 2.87 220224 | EUR | 6.079.057,96 | 0,57 | 0,47 |
| TitGlFin 2.37 161124 | EUR | 6.067.100,33 | 0,57 | 0,47 |
| WalnBidc 6.75 010824 | EUR | 6.066.524,80 | 0,57 | 0,47 |
| PetGlFin 4.75 140125 | EUR | 6.058.328,77 | 0,57 | 0,47 |
| GruAntlr 3.37 300426 | EUR | 5.921.229,22 | 0,56 | 0,46 |
| CasinoGu 1.86 130622 | EUR | 5.904.272,73 | 0,56 | 0,46 |
| GameGr FRN 270423 | EUR | 5.806.034,54 | 0,55 | 0,45 |
| SisalGr 7 310723 | EUR | 5.751.142,78 | 0,54 | 0,45 |
| Loxam 2.87 150426 | EUR | 5.557.065,75 | 0,53 | 0,43 |
| GrEcoHgs FRN 151123 | EUR | 5.435.833,33 | 0,51 | 0,42 |
| ArdPacUS 6.75 150524 | EUR | 5.417.737,50 | 0,51 | 0,42 |
| MobilFin 5.5 151124 | EUR | 5.377.085,83 | 0,51 | 0,42 |
| MasarInv 5 150924 | EUR | 5.354.563,71 | 0,51 | 0,42 |

| Titoli | Valuta | Importo (EUR) | Percentuale | |
|----------------------|------------|-----------------------|------------------|-------------------|
| | | | Patrimonio netto | Patrimonio totale |
| Fabric FRN 301124 | EUR | 5.268.274,61 | 0,50 | 0,41 |
| PaprecHg 4 310325 | EUR | 5.244.140,88 | 0,50 | 0,41 |
| Nemak 3.25 150324 | EUR | 5.178.416,37 | 0,49 | 0,40 |
| GualClos FRN 150424 | EUR | 5.102.783,97 | 0,48 | 0,40 |
| Tenneco 5 150724 | EUR | 4.970.037,33 | 0,47 | 0,39 |
| ScienGam 5.5 150226 | EUR | 4.951.060,72 | 0,47 | 0,39 |
| EurMobGr 4.12 151124 | EUR | 4.832.474,42 | 0,46 | 0,38 |
| JagLRoAu 4.5 150126 | EUR | 4.780.107,00 | 0,45 | 0,37 |
| TevPhFin 3.25 150422 | EUR | 4.760.281,94 | 0,45 | 0,37 |
| KME 6.75 010223 | EUR | 4.353.347,25 | 0,41 | 0,34 |
| SGLCarbo 4.62 300924 | EUR | 4.302.616,25 | 0,41 | 0,33 |
| Nexans 3.75 080823 | EUR | 4.152.122,41 | 0,39 | 0,32 |
| TevPhFin 4.5 010325 | EUR | 4.131.720,00 | 0,39 | 0,32 |
| LaFinAta 4 150524 | EUR | 4.107.144,00 | 0,39 | 0,32 |
| HapaLloy 5.12 150724 | EUR | 3.761.736,32 | 0,36 | 0,29 |
| CasinoGu VAR 070324 | EUR | 3.679.446,14 | 0,35 | 0,29 |
| Equinix 2.87 010226 | EUR | 3.676.055,35 | 0,35 | 0,29 |
| AlmItaln 7.25 151022 | EUR | 3.511.493,75 | 0,33 | 0,27 |
| VolvoCar 2.12 020424 | EUR | 3.442.145,69 | 0,33 | 0,27 |
| SunshMid 6.5 150526 | EUR | 3.305.730,64 | 0,31 | 0,26 |
| CasinoGu VAR 070225 | EUR | 3.183.724,18 | 0,30 | 0,25 |
| CMACGM 6.5 150722 | EUR | 3.106.999,19 | 0,29 | 0,24 |
| Salilmpr 3.75 240621 | EUR | 3.104.163,99 | 0,29 | 0,24 |
| LoxaMod 3.25 140125 | EUR | 3.078.306,18 | 0,29 | 0,24 |
| Elis 1.75 110424 | EUR | 2.937.423,08 | 0,28 | 0,23 |
| Ipd3Bv 4.5 150722 | EUR | 2.909.438,00 | 0,28 | 0,23 |
| Faurecia 2.62 150625 | EUR | 2.798.193,52 | 0,26 | 0,22 |
| BurKinFr 6 010524 | EUR | 2.731.216,67 | 0,26 | 0,21 |
| CMACGM 5.25 150125 | EUR | 2.690.187,00 | 0,25 | 0,21 |
| PartsEu 4.37 010522 | EUR | 2.672.255,81 | 0,25 | 0,21 |
| DigiCom 5 151023 | EUR | 2.632.986,11 | 0,25 | 0,20 |
| TevPhFin 1.12 151024 | EUR | 2.305.917,95 | 0,22 | 0,18 |
| Playtech 3.75 121023 | EUR | 2.289.237,51 | 0,22 | 0,18 |
| LHMCFin2 7.25 021025 | EUR | 2.097.088,50 | 0,20 | 0,16 |
| JagLRoAu 2.2 150124 | EUR | 2.071.189,33 | 0,20 | 0,16 |
| ConGIPow 4.12 010825 | EUR | 2.037.198,21 | 0,19 | 0,16 |
| Equinix 2.87 011025 | EUR | 1.560.299,79 | 0,15 | 0,12 |
| CirFinIn FRN 300925 | EUR | 1.053.720,81 | 0,10 | 0,08 |
| INEOSFin 2.12 151125 | EUR | 988.046,81 | 0,09 | 0,08 |
| LaFinAta 5.12 150525 | EUR | 758.742,64 | 0,07 | 0,06 |
| Telecolt 4 110424 | EUR | 559.868,71 | 0,05 | 0,04 |
| TOTALE | EUR | 897.292.521,36 | 84,81 | 69,83 |
| WillHill 4.75 010526 | GBP | 13.445.579,36 | 1,27 | 1,05 |
| PremFood 6.25 151023 | GBP | 8.900.772,80 | 0,84 | 0,69 |
| VirMRFNI 5.5 150924 | GBP | 7.344.052,30 | 0,69 | 0,57 |

| Titoli | Valuta | Importo (EUR) | Percentuale | |
|----------------------|------------|----------------------|------------------|-------------------|
| | | | Patrimonio netto | Patrimonio totale |
| DraxFin 4.25 010522 | GBP | 6.112.645,90 | 0,58 | 0,48 |
| MacLaFin 5 010822 | GBP | 5.209.745,39 | 0,49 | 0,41 |
| LaFinAta 6.62 150525 | GBP | 3.405.310,90 | 0,32 | 0,27 |
| IcelBo 6.75 150724 | GBP | 3.089.552,34 | 0,29 | 0,24 |
| AMCapHgs 5.75 150422 | GBP | 2.816.115,60 | 0,27 | 0,22 |
| BMEurVaR 4.12 010222 | GBP | 2.448.284,10 | 0,23 | 0,19 |
| JagLAuRo 5 150222 | GBP | 2.139.884,38 | 0,20 | 0,17 |
| WillHill 4.87 070923 | GBP | 2.079.023,48 | 0,20 | 0,16 |
| TOTALE | GBP | 56.990.966,55 | 5,39 | 4,44 |

RIPARTIZIONE DEL PATRIMONIO PER SETTORE ECONOMICO

| Settore di attività | Percentuale | |
|--|------------------|-------------------|
| | Patrimonio netto | Patrimonio totale |
| Società finanziarie plurisetoriali | 7,46 | 6,16 |
| Altri servizi finanziari | 6,80 | 5,60 |
| Parti di ricambio e attrezzature per automezzi | 6,54 | 5,38 |
| Servizi integrati di telecomunicazione | 6,24 | 5,14 |
| Casinò e case da gioco | 5,58 | 4,59 |
| Consulenza giuridica e contabile | 4,81 | 3,96 |
| Altri settori | 52,77 | 43,43 |
| TOTALE | 90,20 | 74,26 |

RIPARTIZIONE DEL PATRIMONIO PER PAESE DI RESIDENZA DELL'EMITTENTE

| Paese | Percentuale | |
|---------------|------------------|-------------------|
| | Patrimonio netto | Patrimonio totale |
| FRANCIA | 16,50 | 13,59 |
| PAESI BASSI | 13,25 | 10,91 |
| REGNO UNITO | 11,39 | 9,38 |
| Altri paesi | 49,06 | 40,38 |
| TOTALE | 90,20 | 74,26 |

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 | 611.635.787,25 | 254.751.994,44 |
| b) Attività finanziarie idonee e strumenti del mercato monetario ammessi alla negoziazione in un altro mercato regolamentato, regolarmente funzionante, riconosciuto e aperto al pubblico, i cui emittenti abbiano 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 | 1.282.030,00 | 0,00 |
| 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 | 44.162.482,00 | 57.012.937,73 |

| Movimenti verificatisi nel corso del periodo | Movimenti (importo) |
|--|---------------------|
| Acquisizioni | 657.080.299,25 |
| Cessioni | 311.764.932,17 |

DISTRIBUZIONE NEL CORSO DEL PERIODO

| | Classe € | Importo netto unitario € | Credito d'imposta € | Importo lordo unitario € |
|---------------------------------|--|--------------------------------|------------------------|--------------------------------|
| | D1 CLASSE DR-EUR D1 CLASSE DR-EUR D2 CLASSE DI-EUR D2 CLASSE DI-EUR D3 CLASSE DN-EUR D3 CLASSE DN-EUR D4 PART DR-USD (H) D4 PART DR-USD (H) | | | |
| Dividendi da distribuire | | | | |
| 04/07/2019 | D1 CLASSE DR-EUR | 3,00 | | 3,00 |
| | D2 CLASSE DI-EUR | 30,04 | | 30,04 |
| | D3 CLASSE DN-EUR | 3,00 | | 3,00 |
| Dividendi distribuiti | | | | |

| | |
|------------------|-------------------------------------|
| Fondo | ODDO BHF HAUT RENDEMENT 2025 (8515) |
| Data | 30/09/2019 |
| Patrimonio netto | 1.057.940.908,64 EUR |

| categoria | codice titolo | denominazione | valuta | Quantità | Quotazione | valore di mercato | % del patrimonio netto |
|---|---------------|---|--------|---------------|------------|-----------------------|------------------------|
| Disponibilità | | | | | | -1.541.961,02 | -0,07% |
| | | Commissione di gestione | EUR | (603.650,38) | 1,00 | -1.207.300,76 | -0,06% |
| | | | CHF | (4.905,19) | 0,92 | -9.026,68 | 0,00% |
| | | | USD | (1.761,42) | 0,92 | -3.231,38 | 0,00% |
| | | Commissione di performance | EUR | (156.525,05) | 1,00 | -313.050,10 | -0,01% |
| | | | USD | (5.097,83) | 0,92 | -9.352,10 | 0,00% |
| Obbligazioni e titoli assimilati | | | | | | 834.198.322,27 | 65,20% |
| | XS1681770464 | Masaria Investments SAU 5% Sen Reg S 17/15.09.24 | EUR | 5.150.000,00 | 103,11 | 10.664.780,21 | 0,51% |
| | XS1895495478 | UGI International LLC 3.25% Sen Reg S 18/01.11.25 | EUR | 6.400.000,00 | 106,29 | 13.691.724,44 | 0,65% |
| | XS1590067432 | Loxam 6% Sen Reg S 17/15.04.25 | EUR | 7.200.000,00 | 104,83 | 15.296.064,00 | 0,73% |
| | XS1602280676 | Drax Finco Plc 4.25% Sen Reg S 17/01.05.22 | GBP | 5.200.000,00 | 102,23 | 12.120.529,15 | 0,58% |
| | XS1716212243 | Titan Global Finance Plc 2.375% Sen Reg S 17/16.11.24 | EUR | 5.805.000,00 | 103,62 | 12.082.125,23 | 0,57% |
| | XS1812903828 | Teva Pharmaceutical Fin II BV 3.25% Ser B Sen 18/15.04.22 | EUR | 5.000.000,00 | 93,70 | 9.445.181,94 | 0,45% |
| | XS1816220328 | Fabric (Bc) SpA FRN Sen Reg S 18/30.11.24 | EUR | 5.176.000,00 | 101,46 | 10.519.585,41 | 0,50% |
| | XS1648303813 | Maxeda DIY Holding Bv 6.125% Sen Reg S 17/15.07.22 | EUR | 7.150.000,00 | 98,38 | 14.161.580,97 | 0,67% |
| | XS1964638107 | Panther BF Agg 2 LP Fin Co Inc 4.375% Sen Reg S 19/15.05.26 | EUR | 8.063.000,00 | 102,68 | 16.735.696,06 | 0,80% |
| | XS1799640666 | LKQ European Holdings BV 3.625% Sen Reg S 18/01.04.26 | EUR | 9.550.000,00 | 105,35 | 20.123.575,63 | 0,96% |
| | BE6275588760 | Sarens Finance Co NV 5.875% 15/05.02.22 | EUR | 6.100.000,00 | 100,72 | 12.344.094,71 | 0,59% |
| | XS1843437549 | INEOS Finance Plc 2.875% Sen Reg S 19/01.05.26 | EUR | 10.600.000,00 | 99,27 | 21.179.839,39 | 1,01% |
| | XS1731657141 | Energopro AS 4% Sen Reg S 17/07.12.22 | EUR | 8.640.000,00 | 103,87 | 18.231.671,15 | 0,87% |
| | XS1713474168 | Nordex SE 6.5% Sen Reg S 18/01.02.23 | EUR | 6.000.000,00 | 103,32 | 12.464.123,33 | 0,59% |
| | XS1756722069 | KME AG 6.75% Sen Reg S 18/01.02.23 | EUR | 5.100.000,00 | 85,34 | 8.705.738,25 | 0,41% |
| | XS1435297202 | Salini Impregilo SpA 3.75% Reg S Sen 16/24.06.21 | EUR | 3.034.000,00 | 101,29 | 6.177.241,91 | 0,29% |
| | XS2036838634 | Swissport Financing Sàrl 5.25% Sen Reg S 19/15.08.24 | EUR | 7.073.000,00 | 104,15 | 14.781.862,70 | 0,70% |
| | XS1735583095 | Platin 1425 GmbH 5.375% Sen Reg S 17/15.06.23 | EUR | 8.450.000,00 | 95,11 | 16.208.584,62 | 0,77% |
| | XS1879565791 | EDreams ODIGEO SA 5.5% Sen Reg S 18/01.09.23 | EUR | 10.265.000,00 | 106,85 | 21.982.400,55 | 1,04% |
| | XS1117300241 | Altice Luxembourg SA 6.25% Reg S Sen 15/15.02.25 | EUR | 11.900.000,00 | 104,94 | 24.976.595,97 | 1,19% |
| | XS1814787054 | Sunshine Mid BV 6.5% Sen Reg S 18/15.05.26 | EUR | 3.050.000,00 | 105,91 | 6.536.016,14 | 0,31% |
| | XS1983375871 | Europcar Mobility Group SA 4% Sen Reg S 19/30.04.26 | EUR | 10.910.000,00 | 102,48 | 22.552.667,11 | 1,07% |
| | XS2059777594 | LHMC Finco 2 Sàrl 7.25% Sen Reg S 19/02.10.25 | EUR | 2.050.000,00 | 102,30 | 4.194.177,00 | 0,20% |
| | XS1713568811 | Constellium SE 4.25% Sen Reg S 17/15.02.26 | EUR | 11.100.000,00 | 104,13 | 23.179.337,58 | 1,10% |
| | XS1820760079 | La Financiere Atalian SA 6.625% Sen Reg S 18/15.05.25 | GBP | 4.000.000,00 | 73,36 | 6.721.606,03 | 0,32% |
| | XS1794209459 | Paprec Holding SA 4% Sen Reg S 18/31.03.25 | EUR | 5.516.000,00 | 94,73 | 10.469.282,20 | 0,50% |
| | XS1785467751 | Faurecia SE 2.625% Sen Reg S 18/15.06.25 | EUR | 2.650.000,00 | 104,81 | 5.575.711,52 | 0,27% |
| | XS1647100848 | CMA CGM 6.5% Sen Reg S 17/15.07.22 | EUR | 3.850.000,00 | 79,31 | 6.160.472,69 | 0,29% |
| | XS1605600532 | La Financiere Atalian SA 4% Sen Reg S 17/15.05.24 | EUR | 5.400.000,00 | 74,54 | 8.132.088,00 | 0,39% |
| | XS2032590007 | Victoria Plc 5.25% Sen Reg S 19/15.07.24 | EUR | 7.623.000,00 | 103,87 | 15.909.239,12 | 0,76% |
| | XS1412547660 | William Hill Plc 4.875% Reg S Sen 16/07.09.23 | GBP | 1.700.000,00 | 107,88 | 4.151.614,14 | 0,20% |
| | XS1025866119 | Jaguar Land Automoti Rover Plc 5% Reg S Sen 14/15.02.22 | GBP | 2.000.000,00 | 94,02 | 4.265.013,89 | 0,20% |
| | XS1881005976 | Jaguar Land Rover Automoti Plc 4.5% Sen Reg S 18/15.01.26 | EUR | 5.400.000,00 | 87,56 | 9.508.239,00 | 0,45% |
| | XS1811351821 | Gamenet Group SpA FRN Reg S Sen 18/27.04.23 | EUR | 5.644.000,00 | 102,05 | 11.565.623,66 | 0,55% |
| | XS1734328799 | Equinix Inc 2.875% Sen 17/01.02.26 | EUR | 3.500.000,00 | 104,54 | 7.335.060,35 | 0,35% |
| | XS1961852750 | Sappi Papier Holdings GmbH 3.125% Sen Reg S 19/15.04.26 | EUR | 8.702.000,00 | 96,40 | 16.917.260,86 | 0,80% |
| | XS1679781424 | Equinix Inc 2.875% Sen 17/01.10.25 | EUR | 1.500.000,00 | 104,01 | 3.120.479,79 | 0,15% |
| | XS1642816554 | Manutentcoop Facility Mgt SpA 9% Sen Reg S 17/15.06.22 | EUR | 9.150.000,00 | 88,40 | 16.422.145,50 | 0,78% |
| | XS1602515733 | Unilabs SubHolding AB 5.75% Sen Reg S 17/15.05.25 | EUR | 8.450.000,00 | 104,85 | 17.903.876,43 | 0,85% |
| | XS1533916299 | Nemak SAB de CV 3.25% Sen Reg S 17/15.03.24 | EUR | 4.950.000,00 | 104,46 | 10.349.235,86 | 0,49% |
| | XS1838072426 | Interxion Holding NV 4.75% Sen Reg S 18/15.06.25 | EUR | 5.950.000,00 | 108,92 | 13.045.720,43 | 0,62% |
| | XS1598243142 | Grupo Antolin Irausa SA 3.25% Sen Reg S 17/30.04.24 | EUR | 6.600.000,00 | 91,44 | 12.160.382,67 | 0,58% |
| | XS1827600724 | Chemours (The) Co 4% Sen Reg S 18/15.05.26 | EUR | 9.600.000,00 | 92,38 | 17.883.669,34 | 0,85% |
| | XS1709347923 | CBR Fashion Holding GmbH 5.125% Sen Reg S 17/01.10.22 | EUR | 7.850.000,00 | 101,16 | 15.883.865,53 | 0,75% |
| | XS1958300375 | Rexel SA 2.75% Sen Reg S 19/15.06.26 | EUR | 13.800.000,00 | 104,98 | 29.086.447,83 | 1,38% |
| | XS1992087996 | EG Global Finance PLC 4.375% Sen Reg S 19/07.02.25 | EUR | 9.373.000,00 | 98,05 | 18.537.847,80 | 0,88% |

| | | | | | | |
|--------------|--|-----|---------------|--------|---------------|-------|
| XS1989833816 | William Hill Plc 4.75% Sen Reg S19/01.05.26 | GBP | 11.200.000,00 | 104,24 | 26.639.550,80 | 1,27% |
| XS1577949149 | 3AB Optique Dev SAS 4% Sen Reg S 17/01.10.23 | EUR | 6.600.000,00 | 103,78 | 13.699.429,33 | 0,65% |
| XS1087780166 | Iceland Bondco Plc 6.75% Sen Reg S 14/15.07.24 | GBP | 2.800.000,00 | 94,50 | 6.080.017,94 | 0,29% |
| XS1813724603 | Teva Pharmaceutical Fin II BV 4.5% 18/01.03.25 | EUR | 4.800.000,00 | 85,69 | 8.244.840,00 | 0,39% |
| XS2035469126 | Walnut Bidco Plc 6.75% Sen Reg S 19/01.08.24 | EUR | 5.696.000,00 | 105,38 | 12.068.969,60 | 0,57% |
| XS1513765922 | Codere Finance 2 (Lux) SA 6.75% Reg S Sen 16/01.11.21 | EUR | 11.200.000,00 | 99,52 | 22.612.352,00 | 1,07% |
| XS1756356371 | Selecta Group BV 5.875% Sen Reg S 18/01.02.24 | EUR | 7.239.000,00 | 104,51 | 15.132.139,16 | 0,72% |
| XS1987729768 | Fnac Darty SA 2.625% Sen Reg S 19/30.05.26 | EUR | 6.955.000,00 | 105,84 | 14.791.633,19 | 0,70% |
| FR0013354297 | Nexans SA 3.75% Sen 18/08.08.23 | EUR | 3.700.000,00 | 111,66 | 8.283.394,41 | 0,39% |
| XS1849518276 | Smurfit Kappa Acquisitions 2.875% Sen Reg S 18/15.01.26 | EUR | 6.673.000,00 | 110,50 | 14.788.364,31 | 0,70% |
| XS1883354976 | Fire (Bc) SPA FRN Sen Reg S 18/30.09.24 | EUR | 10.300.000,00 | 101,92 | 20.998.200,82 | 1,00% |
| XS1694628287 | Almaviva Italian Inno Co SpA 7.25% Sen Reg S 17/15.10.22 | EUR | 4.500.000,00 | 74,67 | 6.871.643,75 | 0,33% |
| XS1639490918 | Tenneco Inc 5% Sen Reg S 17/15.07.24 | EUR | 4.800.000,00 | 102,47 | 9.888.741,33 | 0,47% |
| XS2033245023 | Cirsa Finance Intl Sàrl FRN Sen Reg S 19/30.09.25 | EUR | 1.026.000,00 | 102,58 | 2.106.201,87 | 0,10% |
| XS1801786275 | Coty Inc 4% Sen Reg S 18/15.04.23 | EUR | 6.350.000,00 | 100,93 | 12.936.064,78 | 0,61% |
| XS1577947440 | INEOS Finance Plc 2.125% Sen Reg S 17/15.11.25 | EUR | 1.000.000,00 | 98,00 | 1.968.006,81 | 0,09% |
| XS1698063739 | Residomo s.r.o. 3.375% Sen Reg S 17/15.10.24 | EUR | 7.900.000,00 | 104,01 | 16.556.474,38 | 0,79% |
| DE000A2NB965 | Kaefer Isoliertechnik GmbH 5.5% Sen Reg S 18/10.01.24 | EUR | 8.500.000,00 | 106,43 | 18.199.586,11 | 0,87% |
| XS1991034825 | Eircom Finance Ltd 3.5% Sen Reg S 19/15.05.26 | EUR | 12.672.000,00 | 107,26 | 27.354.208,64 | 1,30% |
| XS1713474754 | Picard BondCo SA 5.5% Sen Reg S 17/30.11.24 | EUR | 9.400.000,00 | 98,31 | 18.613.342,11 | 0,88% |
| XS1813504666 | Sigma Holdco BV 5.75% Sen Reg S 18/15.05.26 | EUR | 9.500.000,00 | 99,83 | 19.176.338,47 | 0,91% |
| FR0013426376 | Spie SAS 2.63% Sen 19/18.06.26 | EUR | 14.400.000,00 | 104,69 | 30.259.331,41 | 1,44% |
| XS1577963058 | Norican A/S 4.5% Sen Reg S 17/15.05.23 | EUR | 9.200.000,00 | 85,18 | 15.830.670,00 | 0,75% |
| XS1843437200 | United Group BV FRN Sen Reg S 19/15.05.25 | EUR | 15.050.000,00 | 101,34 | 30.584.680,10 | 1,45% |
| XS1405770576 | Digi Communications NV 5% Reg S Sen 16/15.10.23 | EUR | 2.500.000,00 | 103,00 | 5.207.986,11 | 0,25% |
| XS1820759147 | La Financiere Atalian SA 5.125% Sen Reg S 18/15.05.25 | EUR | 1.000.000,00 | 74,35 | 1.502.252,64 | 0,07% |
| XS1713466222 | Novafives 5% Sen Reg S 18/15.06.25 | EUR | 13.400.000,00 | 86,57 | 23.399.094,89 | 1,11% |
| XS1703065620 | CMA CGM 5.25% Sen Reg S 17/15.01.25 | EUR | 3.600.000,00 | 72,29 | 5.292.699,00 | 0,25% |
| XS1517169899 | Parts Europe SA 4.375% Reg S Sen 16/01.05.22 | EUR | 2.600.000,00 | 100,94 | 5.296.799,81 | 0,25% |
| XS1844997970 | Intl Game Technology Plc 3.5% Sen Reg S 18/15.07.24 | EUR | 7.500.000,00 | 108,57 | 16.341.795,83 | 0,78% |
| XS1823568248 | Premier Foods Finance Plc 6.25% Sen Reg S 18/15.10.23 | GBP | 7.368.000,00 | 103,99 | 17.560.119,97 | 0,83% |
| XS1439749281 | Teva Pharmaceutical Fin II BV 1.125% Reg S Sen 16/15.10.24 | EUR | 3.000.000,00 | 75,78 | 4.579.287,95 | 0,22% |
| XS1849464323 | Playtech Plc 3.75% Sen Reg S 18/12.10.23 | EUR | 2.142.000,00 | 105,10 | 4.540.543,77 | 0,22% |
| XS1956187550 | Playtech Plc 4.25% Sen Reg S 19/07.03.26 | EUR | 8.000.000,00 | 108,15 | 17.327.131,11 | 0,82% |
| XS1577956516 | Maclaren Finance Plc 5% Sen Reg S 17/01.08.22 | GBP | 4.750.000,00 | 96,20 | 10.374.009,70 | 0,49% |
| XS2004438458 | IHO Verwaltungs GmbH 3.625% Sen Reg S 19/15.05.25 | EUR | 10.147.458,00 | 104,23 | 21.271.715,95 | 1,01% |
| XS2021472084 | TVL Finance PLC FRN Sen Reg S 19/15.07.25 | GBP | 10.440.000,00 | 97,77 | 23.248.056,39 | 1,10% |
| XS2052286676 | Matterhorn Telecom SA 2.625% Sen Reg S 19/15.09.24 | EUR | 11.186.000,00 | 103,98 | 23.273.009,00 | 1,11% |
| XS1812087598 | Grupo Antolin Irausa SA 3.375% Sen Reg S 18/30.04.26 | EUR | 6.709.000,00 | 86,83 | 11.746.855,19 | 0,56% |
| XS1975699569 | Loxam 2.875% Sen Reg S 19/15.04.26 | EUR | 5.400.000,00 | 101,54 | 11.040.387,75 | 0,52% |
| XS1533915564 | Aston Martin Capital Hgs Ltd 5.75% Sen Reg S 17/15.04.22 | GBP | 2.700.000,00 | 89,62 | 5.550.838,52 | 0,26% |
| XS1498566766 | Virgin Med Re Fin N I De Ac Co 5.5% Sen Reg S 16/15.09.24 | GBP | 6.300.000,00 | 102,89 | 14.669.612,36 | 0,70% |
| XS1766775545 | Scientific Games Intl Inc 3.375% Sen Reg S 18/15.02.26 | EUR | 6.500.000,00 | 103,16 | 13.439.700,63 | 0,64% |
| XS1533914591 | Adler Pelzer Holding GmbH 4.125% Sen Reg S 17/01.04.24 | EUR | 8.400.000,00 | 94,43 | 15.864.698,50 | 0,75% |
| XS1707063589 | Salini Impregilo SpA 1.75% Sen Reg S 17/26.10.24 | EUR | 7.600.000,00 | 88,83 | 13.625.806,79 | 0,65% |
| XS2037052631 | ContourGlobal Power Hgs SA 4.125% Sen Reg S 19/01.08.25 | EUR | 1.900.000,00 | 106,52 | 4.061.116,21 | 0,19% |
| XS1645113322 | Hapag-Lloyd AG 5.125% Sen Reg S 17/15.07.24 | EUR | 3.500.000,00 | 106,38 | 7.485.106,32 | 0,36% |
| XS1454980159 | Sisal Group SpA 7% Reg S Sen 16/31.07.23 | EUR | 5.450.000,00 | 104,32 | 11.436.582,78 | 0,54% |
| XS1860216909 | Promontoria Hg 264 B.V 6.75% Sen Reg S 18/15.08.23 | EUR | 7.881.000,00 | 93,80 | 14.854.837,79 | 0,71% |
| XS2031870921 | Loxam Module SAS 3.25% Sen Reg S 19/14.01.25 | EUR | 2.967.000,00 | 103,60 | 6.152.058,84 | 0,29% |
| XS1963830002 | Faurecia SE 3.125% Sen Reg S 19/15.06.26 | EUR | 8.367.000,00 | 106,69 | 17.931.888,28 | 0,85% |
| XS1990952779 | Cirsa Finance Intl Sàrl 4.75% Sen Reg S 19/22.05.25 | EUR | 12.100.000,00 | 105,94 | 25.845.512,61 | 1,23% |
| XS1600514696 | Burger King France SAS 6% Sen Reg S 17/01.05.24 | EUR | 2.500.000,00 | 106,73 | 5.399.516,67 | 0,26% |
| XS1767052050 | Algeco Global Fin Plc 6.5% Sen Reg S 18/15.02.23 | EUR | 10.900.000,00 | 101,19 | 22.152.354,61 | 1,05% |
| XS1406669983 | Ardagh Pac Fin Plc Hgs USA Inc 6.75% Reg S Sen 16/15.05.24 | EUR | 5.000.000,00 | 105,79 | 10.707.037,50 | 0,51% |
| XS1551347393 | Jaguar Land Rover Automoti Plc 2.2% Reg S Sen 17/15.01.24 | EUR | 2.400.000,00 | 85,83 | 4.131.085,33 | 0,20% |
| XS2015218584 | Diocle SpA FRN Sen Reg S 19/30.06.26 | EUR | 9.057.000,00 | 102,46 | 18.574.445,47 | 0,88% |
| XS1888268064 | Guala Closures SpA FRN Sen Reg S 18/15.04.24 | EUR | 4.971.000,00 | 101,88 | 10.167.387,90 | 0,48% |
| XS1908248963 | International Design Gr S.p.A. 6.5% Sen Reg S 18/15.11.25 | EUR | 7.100.000,00 | 103,44 | 14.863.822,38 | 0,71% |
| XS1713463633 | Kraton Polymers LLC Cap Corp 5.25% Sen Reg S 18/15.05.26 | EUR | 7.592.000,00 | 105,76 | 16.210.687,62 | 0,77% |
| XS1766775891 | Scientific Games Intl Inc 5.5% Sen Reg S 18/15.02.26 | EUR | 4.900.000,00 | 100,32 | 9.866.936,72 | 0,47% |

| | | | | | | |
|---------------------------|--|-----|-----------------|--------|-----------------------|---------------|
| XS0982711714 | Petrobras Global Finance BV 4.75% Sen 14/14.01.25 | EUR | 5.000.000,00 | 117,77 | 11.946.828,77 | 0,57% |
| XS1945271952 | SGL Carbon SE 4.625% Sen Reg S 19/30.09.24 | EUR | 4.500.000,00 | 95,59 | 8.604.076,25 | 0,41% |
| XS1859543073 | ContourGlobal Power Hgs SA 4.125% Sen Reg S 18/01.08.25 | EUR | 9.388.000,00 | 106,52 | 20.066.188,93 | 0,95% |
| XS2054539627 | Altice France SA 2.5% Sen Reg S 19/15.01.25 | EUR | 13.016.000,00 | 101,88 | 26.525.921,04 | 1,26% |
| XS1720016531 | Verisure Midholding AB 5.75% Sen Reg S 17/01.12.23 | EUR | 5.900.000,00 | 103,77 | 12.358.531,69 | 0,59% |
| XS1170079443 | Ziggo Bond Co BV 4.625% Reg S Sen 15/15.01.25 | EUR | 9.300.000,00 | 103,54 | 19.350.438,96 | 0,92% |
| XS1706202592 | Europcar Mobility Group SA 4.125% Sen Reg S 17/15.11.24 | EUR | 4.600.000,00 | 103,48 | 9.592.738,42 | 0,46% |
| XS2009038113 | Intl Game Technology Plc 3.5% Sen Reg S 19/15.06.26 | EUR | 9.215.000,00 | 106,87 | 19.787.707,38 | 0,94% |
| XS1881594946 | Rossini Sàrl 6.75% Sen Reg S 18/30.10.25 | EUR | 11.000.000,00 | 111,10 | 24.755.500,00 | 1,18% |
| XS1684813493 | Viridian Group FinanceCo Plc 4% Sen Reg S 17/15.09.25 | EUR | 8.100.000,00 | 103,10 | 16.718.148,00 | 0,79% |
| XS1468662801 | Adient GI Hgs Ltd 3.5% Reg S Sen 16/15.08.24 | EUR | 9.500.000,00 | 85,71 | 16.328.649,57 | 0,78% |
| XS1843435410 | Novem Group GmbH FRN Sen Reg S 19/15.05.24 | EUR | 6.644.000,00 | 102,18 | 13.624.053,52 | 0,65% |
| XS1910293643 | Groupe Ecore Holding SAS FRN Sen Reg S 18/15.11.23 | EUR | 5.500.000,00 | 98,00 | 10.825.833,33 | 0,51% |
| Titoli di debito | | | | | 288.032.696,61 | 13,69% |
| XS1846631049 | Telecom Italia SpA 2.875% EMTN Sen Reg S 18/28.01.26 | EUR | 6.925.000,00 | 105,79 | 14.786.367,20 | 0,70% |
| XS1814065345 | Gestamp Automocion 3.25% EMTN Sen Reg S 18/30.04.26 | EUR | 10.800.000,00 | 101,18 | 22.003.080,00 | 1,05% |
| XS1969645255 | PPF Arena 1 BV 3.125% EMTN Sen Reg S 19/27.03.26 | EUR | 17.109.000,00 | 106,45 | 36.700.469,62 | 1,74% |
| XS1991114858 | Dometic Group AB 3% EMTN Sen Reg S 19/08.05.26 | EUR | 7.197.000,00 | 105,61 | 15.288.365,29 | 0,73% |
| XS1512670412 | Mobilux Finance SAS 5.5% EMTN Reg S Sen 16/15.11.24 | EUR | 5.100.000,00 | 103,34 | 10.647.425,83 | 0,51% |
| FR0013318102 | Elis SA 2.875% EMTN Sen 18/15.02.26 | EUR | 9.400.000,00 | 110,24 | 20.894.862,12 | 0,99% |
| XS1811792792 | Samsonite Finco Sàrl 3.5% EMTN Sen Reg S 18/15.05.26 | EUR | 6.900.000,00 | 102,18 | 14.192.192,16 | 0,67% |
| XS1577954149 | IPD 3 BV 4.5% EMTN Sen Reg S 17/15.07.22 | EUR | 2.800.000,00 | 102,95 | 5.791.926,00 | 0,28% |
| FR0012369122 | Casino Guichard Perrachon VAR EMTN Lk Rating 14/07.02.25 | EUR | 3.500.000,00 | 88,64 | 6.286.089,18 | 0,30% |
| FR0013413556 | Elis SA 1.75% EMTN Sen 19/11.04.24 | EUR | 2.800.000,00 | 104,08 | 5.851.551,08 | 0,28% |
| XS1799975922 | Gobalworth Real Estate Invs Ltd 3% EMTN Sen RegS 18/29.03.25 | EUR | 8.090.000,00 | 109,75 | 17.880.905,26 | 0,85% |
| DE000A2TEDB8 | ThyssenKrupp AG 2.875% EMTN Sen Reg S 19/22.02.24 | EUR | 5.777.000,00 | 103,48 | 12.057.097,56 | 0,57% |
| FR0013414919 | Orano SA 3.375% EMTN Sen 19/23.04.26 | EUR | 12.700.000,00 | 108,24 | 27.682.425,26 | 1,32% |
| FR0011765825 | Casino Guichard Perrachon VAR EMTN Step-up Sen 14/07.03.24 | EUR | 3.800.000,00 | 94,26 | 7.261.288,14 | 0,35% |
| XS1711584430 | Saipem Finance Intl BV 2.625% EMTN Ser 4 Sen 17/07.01.25 | EUR | 9.800.000,00 | 104,93 | 20.754.968,93 | 0,99% |
| XS1419869885 | Telecom Italia SpA 3.625% EMTN Reg S Sen 16/25.05.26 | EUR | 5.800.000,00 | 110,85 | 12.933.162,96 | 0,61% |
| XS1971935223 | Volvo Car AB 2.125% EMTN Sen Reg S 19/02.04.24 | EUR | 3.253.000,00 | 104,75 | 6.849.728,25 | 0,33% |
| XS1935256369 | Telecom Italia SpA 4% EMTN Sen Reg S 19/11.04.24 | EUR | 497.000,00 | 110,75 | 1.110.286,27 | 0,05% |
| XS1557228357 | B&M European Value Retail SA 4.125% EMTN Reg S 17/01.02.22 | GBP | 2.100.000,00 | 102,46 | 4.879.979,57 | 0,23% |
| XS1982819994 | Telecom Italia SpA 2.75% EMTN Sen Reg S 19/15.04.25 | EUR | 5.871.000,00 | 105,03 | 12.407.614,20 | 0,59% |
| FR0013260379 | Casino Guichard Perrachon 1.865% EMTN Sen Reg S 17/13.06.22 | EUR | 6.300.000,00 | 93,15 | 11.772.911,73 | 0,56% |
| Movimenti di cassa | | | | | 91.066.673,48 | 4,33% |
| | ODDO & Cie SA | EUR | 24.943.547,25 | 1,00 | 49.887.094,50 | 2,37% |
| | | GBP | 8.135,93 | 1,13 | 18.389,80 | 0,00% |
| | | CHF | (13.409,62) | 0,92 | -24.676,80 | 0,00% |
| | | USD | (433.409,24) | 0,92 | -795.100,42 | -0,04% |
| | Commissione di gestione | EUR | (234.491,00) | 1,00 | -468.982,00 | -0,02% |
| | | CHF | (1.402,44) | 0,92 | -2.580,82 | 0,00% |
| | | USD | (105,65) | 0,92 | -193,82 | 0,00% |
| | CPTN EONIA 0.00 2509 | EUR | (1.197.525,00) | 1,00 | -2.394.974,55 | -0,11% |
| | SELL GBP EUR 15/10/2019 | EUR | (61.050.487,00) | 1,13 | -548.627,14 | -0,03% |
| | Gara0.00 300920 | EUR | (685.300,70) | 1,00 | -1.370.601,40 | -0,07% |
| | CPTN EONIA 0.00 2108 | EUR | (3.370.500,00) | 1,00 | -6.739.908,52 | -0,32% |
| | CPTN EONIA 0.00 0507 | EUR | (3.772.984,84) | 1,00 | -7.544.747,86 | -0,36% |
| | BUY CHF EUR 15/10/2019 G5 | EUR | 8.931.351,00 | 0,92 | 41.957,74 | 0,00% |
| | ADM OTC - SOGENE EUR | EUR | 190.000,00 | 1,00 | 380.000,00 | 0,02% |
| | CPTN EONIA 0.00 2609 | EUR | (3.247.125,00) | 1,00 | -6.494.086,46 | -0,31% |
| | CPTN EONIA 0.00 0609 | EUR | (1.488.375,00) | 1,00 | -2.976.342,68 | -0,14% |
| | DebDiv S/R USD | USD | 305.863,00 | 0,92 | 561.113,56 | 0,03% |
| | Creditori vari S/R EUR | EUR | (95.588.040,03) | 1,00 | -191.176.080,06 | -9,09% |
| | BUY USD EUR 15/10/2019 G6 | EUR | 1.716.948,00 | 0,92 | 45.362,64 | 0,00% |
| | BUY CHF EUR 15/10/2019 G4 | EUR | 1.582.962,00 | 0,92 | 4.417,02 | 0,00% |
| | CPTN EONIA 0.00 1503 | EUR | (217.959,00) | 1,00 | -435.847,42 | -0,02% |
| | ADM Repo - ODDO EUR | EUR | (367.000,00) | 1,00 | -734.000,00 | -0,03% |
| | Debitori vari EUR | EUR | 1.083.400,00 | 1,00 | 2.166.800,00 | 0,10% |
| | BUY GBP EUR 15/10/2019 | EUR | 525.000,00 | 1,13 | 4.851,66 | 0,00% |
| | BUY CHF EUR 15/10/2019 G4 | EUR | 1.843.646,00 | 0,92 | 23.370,48 | 0,00% |

| | | | | | | |
|---|--|-----|----------------|------|-----------------------|---------------|
| | SELL USD EUR 15/10/2019 | EUR | (147.625,00) | 0,92 | -4.073,40 | 0,00% |
| | BUY USD EUR 15/10/2019 G7 | EUR | 706.200,00 | 0,92 | 21.721,50 | 0,00% |
| | Debitori vari S/R EUR | EUR | 102.262.475,53 | 1,00 | 204.524.951,06 | 9,72% |
| | CPTN EONIA 0.00 2709 | EUR | (469.056,00) | 1,00 | -938.094,33 | -0,04% |
| | Creditore vari titoli EUR | EUR | (2.050.015,00) | 1,00 | -4.100.030,00 | -0,19% |
| | CPTN EONIA 0.00 2409 | EUR | (997.500,00) | 1,00 | -1.994.924,58 | -0,09% |
| | CPTN EONIA 0.00 1908 | EUR | (735.000,00) | 1,00 | -1.469.761,98 | -0,07% |
| | ODDO ET CIE PARIS | EUR | 30.116.837,77 | 1,00 | 60.233.675,54 | 2,86% |
| | BUY USD EUR 15/10/2019 | EUR | 147.625,00 | 0,92 | 4.040,92 | 0,00% |
| | SELL CHF EUR 15/10/2019 G5 | EUR | (6.101,00) | 0,92 | -0,30 | 0,00% |
| XS1799640666 | LKQ European Holdings BV 3.625% Sen Reg S 18/01.04.26 | EUR | 9.550,00 | - | 346.187,50 | 0,02% |
| XS1756722069 | KME AG 6.75% Sen Reg S 18/01.02.23 | EUR | 5.100,00 | - | 344.250,00 | 0,02% |
| XS1117300241 | Altice Luxembourg SA 6.25% Reg S Sen 15/15.02.25 | EUR | 11.900,00 | - | 743.750,00 | 0,04% |
| XS1679781424 | Equinix Inc 2.875% Sen 17/01.10.25 | EUR | 1.500,00 | - | 43.125,00 | 0,00% |
| XS1709347923 | CBR Fashion Holding GmbH 5.125% Sen Reg S 17/01.10.22 | EUR | 7.850,00 | - | 402.312,50 | 0,02% |
| XS1577949149 | 3AB Optique Dev SAS 4% Sen Reg S 17/01.10.23 | EUR | 6.600,00 | - | 264.000,00 | 0,01% |
| XS1756356371 | Selecta Group BV 5.875% Sen Reg S 18/01.02.24 | EUR | 7.239,00 | - | 425.291,26 | 0,02% |
| XS1883354976 | Fire (Bc) SPA FRN Sen Reg S 18/30.09.24 | EUR | 10.300,00 | - | 246.635,62 | 0,01% |
| XS2033245023 | Cirsa Finance Intl Sàrl FRN Sen Reg S 19/30.09.25 | EUR | 400,00 | - | 3.947,22 | 0,00% |
| XS1533914591 | Adler Pelzer Holding GmbH 4.125% Sen Reg S 17/01.04.24 | EUR | 8.400,00 | - | 346.500,00 | 0,02% |
| XS1945271952 | SGL Carbon SE 4.625% Sen Reg S 19/30.09.24 | EUR | 4.500,00 | - | 196.562,50 | 0,01% |
| Operazioni di concessione e assunzione di titoli in prestito | | | | | -56.228.032,86 | -2,67% |
| | XS2033245023 250920 | EUR | (405.280,00) | - | -810.521,80 | -0,04% |
| | XS1577956516 300920 | GBP | 579.425,00 | - | 0,00 | 0,00% |
| | XS1735583095 250920 | EUR | 482.500,00 | - | 26,81 | 0,00% |
| | XS1814065345 300920 | EUR | (895.400,00) | - | -1.790.800,00 | -0,09% |
| | XS1713466222 260920 | EUR | (261.000,00) | - | -521.936,88 | -0,02% |
| | XS1881005976 250920 | EUR | (650.088,80) | - | -1.300.025,68 | -0,06% |
| | XS1681770464 260920 | EUR | 566.500,00 | - | 68,45 | 0,00% |
| | XS1645113322 260920 | EUR | 1.926.000,00 | - | 220,69 | 0,00% |
| | XS1117300241 170720 | EUR | (215.220,00) | - | -429.996,28 | -0,02% |
| | XS1716212243 200920 | EUR | (103.970,00) | - | -207.918,19 | -0,01% |
| | XS2032590007 190820 | EUR | 700.000,00 | - | 535,69 | 0,00% |
| | XS1961852750 070820 | EUR | (1.009.500,00) | - | -2.017.760,92 | -0,10% |
| | XS1713474168 100120 | EUR | (373.000,00) | - | -734.947,40 | -0,03% |
| | XS1713474754 200920 | EUR | (2.164.800,00) | - | -4.328.153,67 | -0,21% |
| | XS1814065345 110920 | EUR | (1.215.000,00) | - | -2.428.252,69 | -0,12% |
| | XS1908248963 110920 | EUR | (247.520,00) | - | -494.935,75 | -0,02% |
| | FR0013318102 270920 | EUR | 446.720,00 | - | 0,00 | 0,00% |
| | XS1814065345 060920 | EUR | 1.417.500,00 | - | 1.612,41 | 0,00% |
| | XS1577949149 270920 | EUR | (135.525,00) | - | -271.050,00 | -0,01% |
| | XS1598243142 060920 | EUR | (159.742,50) | - | -319.310,99 | -0,02% |
| | XS1713474168 020920 | EUR | (319.200,00) | - | -637.405,28 | -0,03% |
| | XS1881005976 020920 | EUR | (425.000,00) | - | -849.408,70 | -0,04% |
| | XS1811792792 100720 | EUR | (1.020.400,00) | - | -2.036.490,40 | -0,10% |
| | XS1681770464 240920 | EUR | (205.700,00) | - | -411.334,74 | -0,02% |
| | XS1814065345 240920 | EUR | (205.500,00) | - | -410.948,52 | -0,02% |
| | XS1881005976 130920 | EUR | (623.000,00) | - | -1.245.589,88 | -0,06% |
| | XS1908248963 100920 | EUR | (1.453.920,00) | - | -2.907.197,73 | -0,14% |
| | XS1648303813 260920 | EUR | 600.000,00 | - | 50,00 | 0,00% |
| | XS1881005976 260920 | EUR | (450.000,00) | - | -899.917,42 | -0,04% |
| | XS1645113322 250920 | EUR | (536.750,00) | - | -1.073.392,46 | -0,05% |
| | XS1814065345 250920 | EUR | (102.860,00) | - | -205.696,25 | -0,01% |
| | XS1713466222 240920 | EUR | (271.800,00) | - | -543.501,71 | -0,03% |
| | XS1681770464 190920 | EUR | (103.000,00) | - | -205.945,49 | -0,01% |
| | XS1681770464 130920 | EUR | (774.375,00) | - | -1.548.202,58 | -0,07% |
| | XS1827600724 250920 | EUR | 658.000,00 | - | 20,56 | 0,00% |
| | XS1590067432 210820 | EUR | 3.210.000,00 | - | 3.749,46 | 0,00% |
| | XS1794209459 270920 | EUR | (141.750,00) | - | -283.500,00 | -0,01% |
| | XS1713466222 100920 | EUR | (280.987,50) | - | -561.548,93 | -0,03% |
| | XS1713474168 070820 | EUR | (432.730,00) | - | -862.826,51 | -0,04% |
| | FR0013318102 250920 | EUR | (1.333.800,00) | - | -2.667.466,14 | -0,13% |
| | XS2032590007 250920 | EUR | (103.280,00) | - | -206.538,16 | -0,01% |
| | XS1961852750 240920 | EUR | (297.750,00) | - | -595.441,96 | -0,03% |
| | FR0013318102 190920 | EUR | (112.000,00) | - | -223.956,28 | -0,01% |
| | XS2032590007 120920 | EUR | (306.000,00) | - | -611.739,21 | -0,03% |
| | XS1598243142 130920 | EUR | (622.170,00) | - | -1.243.960,67 | -0,06% |
| | XS1117300241 050720 | EUR | 3.593.318,90 | - | 1.809,14 | 0,00% |

| | | | | | | | |
|-------------------------|---------------------|--------------------------|----------------|-----------|---------------|-----------------------|----------------|
| | XS1713474168 150320 | EUR | 207.580,00 | - | 627,06 | 0,00% | |
| | XS1794209459 300920 | EUR | (188.000,00) | - | -376.000,00 | -0,02% | |
| | XS1512670412 260920 | EUR | (209.200,00) | - | -418.377,30 | -0,02% | |
| | XS1713466222 020920 | EUR | (465.000,00) | - | -929.004,29 | -0,04% | |
| | XS1811792792 020820 | EUR | (515.000,00) | - | -1.028.518,57 | -0,05% | |
| | XS1517169899 120620 | EUR | (201.460,00) | - | -402.157,84 | -0,02% | |
| | XS1849518276 030620 | EUR | (530.000,00) | - | -1.058.573,73 | -0,05% | |
| | XS1512670412 230920 | EUR | (1.235.614,60) | - | -2.471.026,94 | -0,12% | |
| | XS1648303813 190920 | EUR | (170.846,10) | - | -341.623,14 | -0,02% | |
| | XS1881005976 190920 | EUR | (360.000,00) | - | -719.789,48 | -0,03% | |
| | XS1881005976 170920 | EUR | (460.000,00) | - | -919.661,84 | -0,04% | |
| | XS1827600724 240920 | EUR | 950.000,00 | - | 49,48 | 0,00% | |
| | XS1512670412 270920 | EUR | (522.000,00) | - | -1.043.943,36 | -0,05% | |
| | XS1713474754 270920 | EUR | (569.695,00) | - | -1.139.390,00 | -0,05% | |
| | XS1961852750 090820 | EUR | (1.923.560,00) | - | -3.843.622,27 | -0,18% | |
| | XS1713474168 240620 | EUR | (180.057,50) | - | -356.294,27 | -0,02% | |
| | XS1713474168 210620 | EUR | (617.340,00) | - | -1.221.445,59 | -0,06% | |
| | XS1982819994 050620 | EUR | (2.042.250,00) | - | -4.079.754,72 | -0,19% | |
| fondi OICVM | | | | | | 123.991.699,24 | 5,89% |
| | FR0010680157 | Oddo BHF Jour CI EUR Cap | EUR | 26.100,00 | 2.375,32 | 123.991.699,24 | 5,89% |
| Patrimonio netto | | | | | | | 100,00% |

ODDO BHF HAUT RENDEMENT 2025

Regolamento sulle operazioni di finanziamento tramite titoli

30-09-2019

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 | | | 28.451.125,05 | | |
| % del patrimonio netto totale | | | 2,68% | | |

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 | 15.605.560,16 | | | | |
| % delle attività prestabili | 1,59% | | | | |

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 | | ODDO | | |
| Importo | 15.605.560,16 | | 28.451.125,05 | | |
| Domicilio | PARIGI | | PARIGI | | |
| 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 | 16.177.964,24 | | 28.088.760,61 | | |
| 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 | 15.605.560,16 | 28.451.125,05 | | | |

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 |
| | Importo custodito | 44.266.724,85 |

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 in % dei rendimenti | 38.033,07 | | 107.079,35 | 205,02 | |
| | 0,27% | | 0,77% | 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 | -39,44 | | -503,20 | -189,37 | |
| Importo | | | | | |
| Gestore | | | | | |
| Importo | | | | | |
| Terzi (es. agente mutuante, ecc.) | | | | | |
| Importo | | | | | |