



## Halbjahresabschluss zum 31. Dezember 2019

### **Oddo BHF European Convertibles Moderate**

#### Investmentfonds nach französischem Recht (Fonds Commun de Placement)

Informationen für Anteilhaber in der Bundesrepublik Deutschland

Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Vertragsbedingungen des Fonds sowie die Jahres- und Halbjahresberichte – jeweils in Papierform – sowie der Nettoinventarwert pro Anteil und die Ausgabe- und Rücknahmepreise sind kostenlos bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle erhältlich. Die vorgenannten Dokumente werden in englischer Sprache zur Verfügung gestellt, mit Ausnahme der wesentlichen Anlegerinformationen, die in deutscher Sprache verfügbar sind.

Ab dem 1. Januar 2020 wird ODDO BHF Asset Management, Bockenheimer Landstraße 10, 60323 Frankfurt am Main, die deutsche Zahl- und Informationsstelle sein.

**DER HALBJAHRESBERICHT WIRD VOM ABSCHLUSSPRÜFER DES OGAW NICHT MIT EINEM PRÜFUNGSVERMERK VERSEHEN.**

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Bestandteile des Fondsvermögens	Betrag zum Abschluss des Berichtszeitraums *
a) in Artikel L. 214-24-55, Abschnitt I, Absatz 1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) aufgeführte Finanztitel	74.295.781,69
b) Guthaben bei Kreditinstituten	4.298.067,94
c) sonstige von dem AIF gehaltene Vermögenswerte	15.038.891,41
d) von dem AIF gehaltene Vermögenswerte insgesamt	93.632.741,04
e) Passiva	-6.173.938,74
f) Nettoinventarwert	87.458.802,30

\* **Negative Beträge sind mit einem Minuszeichen gekennzeichnet**

## ANZAHL DER IN UMLAUF BEFINDLICHEN ANTEILE ODER AKTIEN UND NETTOINVENTARWERT

Anteil	Anteilstyp	Nettovermögen pro Anteil	Anzahl der in Umlauf befindlichen Anteile	Nettoinventarwert
OdConvEM CR C	Thesaurierung	51.737.224,78	320.486,78	161,43
OddEuCoM CI C	Thesaurierung	31.018.435,37	25.840,89	1.200,36
OdConvEM GC C	Thesaurierung	1.028.149,32	9.980,38	103,01
OdConvEM CR Hg C	Thesaurierung	503.541,48	5.942,00	84,74
OdConvEM CI Hg C	Thesaurierung	1.029.342,74	1.118,00	920,70
OdConvEM CRe C	Thesaurierung	45.825,77	471,08	97,27
OdConvEM CN C	Thesaurierung	2.096.282,84	20.129,44	104,14

## BESTANDTEILE DES WERTPAPIERPORTFOLIOS

Bestandteile des Wertpapierportfolios:	Prozentualer Anteil	
	Nettovermögen	Vermögen insgesamt
a) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gemäß Artikel L. 422-1 des Code Monétaire et Financier gehandelt werden	83,50	77,99
b) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt gehandelt werden, der sich in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder einem anderen Staat befindet, der dem Europäischen Wirtschaftsraum angehört	0,00	0,00
c) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittstaats zugelassen sind oder an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt eines Drittstaats gehandelt werden, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf einer von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde veröffentlichten Liste steht oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Markts per Gesetz oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,75	0,70
d) In Artikel R. 214-11, Abschnitt I, Absatz 4 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) aufgeführte neu emittierte Finanztitel	0,00	0,00
e) Sonstige Vermögenswerte: Es handelt sich um die in Artikel R. 214-11, Abschnitt II des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) aufgeführten Vermögenswerte	6,78	6,34

**AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE NACH WÄHRUNG**

Titel	Währung	Betrag (EUR)	Prozentualer Anteil	
			Nettovermögen	Vermögen insgesamt
Telecom Italia SpA 1.125% Conv Sen 15/26.03.22	EUR	7.454.536,17	8,52	7,96
Cellnex Telecom SA 1.5% Conv EMTN Sen Reg S 18/16.01.26	EUR	3.521.168,96	4,03	3,76
Deutsche Post AG 0.05% Conv Sen Reg S 17/30.06.25	EUR	3.277.323,80	3,75	3,50
Deutsche Wohnen SE 0.6% Conv Sen Reg S 17/05.01.26	EUR	3.074.325,16	3,52	3,28
Deutsche Wohnen SE 0.325% Conv Sen Reg S 17/26.07.24	EUR	3.066.690,97	3,51	3,28
SAFRAN SA 0% Conv Sen Reg S 18/21.06.23	EUR	2.922.561,00	3,34	3,12
LEG Immobilien AG 0.875% Sen Reg S Conv 17/01.09.25	EUR	2.903.589,42	3,32	3,10
Orpea SA 0.375% Conv Sen Reg S 19/17.05.27	EUR	2.877.887,25	3,29	3,07
Iberdrola Intl BV 0% Conv Reg S Iberdrola SA 15/11.11.22	EUR	2.777.064,00	3,18	2,97
Bayer AG 0.05% Conv Covestro Ser 1COV Sen Reg S 17/15.06.20	EUR	2.600.002,49	2,97	2,78
MTU Aero Engines AG 0.05% Conv Sen Reg S 19/18.03.27	EUR	2.394.493,58	2,74	2,56
Airbus SE 0% Conv DassAvia EMTN Reg S Sen 16/14.06.21	EUR	2.356.420,00	2,69	2,52
Fresenius SE & Co KGaA 0% Conv 17/31.01.24	EUR	2.171.983,00	2,48	2,32
Air France KLM 0.125% Conv Sen Reg S 19/25.03.26	EUR	2.136.361,50	2,44	2,28
Edenred SA 0% Conv Sen Reg S 19/06.09.24	EUR	1.911.340,80	2,19	2,04
RAG-Stiftung 0% Conv EvoniInd Re Sen Reg S 17/16.03.23	EUR	1.765.722,00	2,02	1,89
Grand City Properties SA VAR Conv Reg S Ser F 16/02.03.22	EUR	1.710.415,65	1,96	1,83
Prysmian SpA 0% Conv Reg S Ser PRYI 17/17.01.22	EUR	1.592.664,00	1,82	1,70
RAG-Stiftung 0% EMTN Conv Evonik Indust AG Reg S 15/18.02.21	EUR	1.539.765,00	1,76	1,64
Nexity 0.25% Conv Sen 18/02.03.25	EUR	1.441.496,25	1,65	1,54
Worldline SA 0% Conv Sen Reg S 19/30.07.26	EUR	1.330.143,41	1,52	1,42
UBISOFT Entertainment SA 0% Conv UBI Sen Reg S 19/24.09.24	EUR	1.260.908,25	1,44	1,35
Adidas AG 0.05% Conv Sen Reg S 18/12.09.23	EUR	1.229.584,37	1,41	1,31
Ingenico Group SA 0% Conv Reg S Sen 15/26.06.22	EUR	1.205.169,00	1,38	1,29
Corporacion Economica Damm SA 1% Conv EbroFood 16/01.12.23	EUR	1.191.415,97	1,36	1,27
ORPAR 0% Conv RemCoint Reg S 17/20.06.24	EUR	1.138.527,50	1,30	1,22
Archer Obligations SA 0% Conv Kering Ser KER Sen 17/31.03.23	EUR	1.039.783,50	1,19	1,11
BE Semiconductor Industries NV 0.5% Conv Sen 17/06.12.24	EUR	1.017.280,00	1,16	1,09
Elis SA 0% Conv Ser Elis Sen Reg S 17/06.10.23	EUR	879.578,70	1,01	0,94
GN Store Nord Ltd 0% Conv Sen Reg S 19/21.05.24	EUR	712.201,00	0,81	0,76
Citigroup Gl Mks Fd Lux SCA 0.5% Conv Ser	EUR	677.528,67	0,77	0,72

Titel	Wahrung	Betrag (EUR)	Prozentualer Anteil	
			Nettovermogen	Vermogen insgesamt
TKA 16/04.08.23				
CA-Immobilien-Anlagen AG 0.75% Conv Sen 17/04.04.25	EUR	658.607,38	0,75	0,70
TAG Immobilien AG 0.625% Conv Sen Reg S 17/01.09.22	EUR	630.534,56	0,72	0,67
Almirall SA 0.25% Sen Conv 18/14.12.21	EUR	621.780,97	0,71	0,66
Atos SE 0% Conv Worldlin Sen Reg S 19/06.11.24	EUR	598.177,50	0,68	0,64
Cellnex Telecom SA 0.5% Conv EMTN 19/05.07.28	EUR	559.000,67	0,64	0,60
Corestate Capital Holding SA 1.375% Conv Sen 17/28.11.22	EUR	520.748,93	0,60	0,56
Silicon On Insulator Tec 0% Conv Soitec Sen Reg S 8/28.06.23	EUR	362.158,50	0,41	0,39
<b>GESAMT</b>	<b>EUR</b>	<b>69.128.939,88</b>	<b>79,04</b>	<b>73,82</b>
Total SA 0.5% Conv Ser FP 15/02.12.22	USD	1.326.359,47	1,52	1,42
Qiagen NV 1% Conv Sen Reg S 18/13.11.24	USD	729.508,43	0,83	0,78
<b>GESAMT</b>	<b>USD</b>	<b>2.055.867,90</b>	<b>2,35</b>	<b>2,20</b>
Remgro Jersey GBP Ltd 2.625% Conv MediIntl 16/22.03.21	GBP	1.421.776,26	1,63	1,52
<b>GESAMT</b>	<b>GBP</b>	<b>1.421.776,26</b>	<b>1,63</b>	<b>1,52</b>
Sika AG 0.15% Conv Sen Reg S 18/05.06.25	CHF	1.074.380,65	1,23	1,15
<b>GESAMT</b>	<b>CHF</b>	<b>1.074.380,65</b>	<b>1,23</b>	<b>1,15</b>
<b>GESAMT</b>		<b>73.680.964,69</b>	<b>84,25</b>	<b>78,69</b>

## AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE NACH WIRTSCHAFTSSEKTOR

Wirtschaftssektor	Prozentualer Anteil	
	Nettovermögen	Vermögen insgesamt
Immobilienverwaltung und -bau	17,39	16,21
Luftfahrt und Verteidigung	8,77	8,20
Sonstige Finanzdienste	8,67	8,10
Integrierte Telekommunikationsdienste	8,52	7,96
Medizinische Infrastruktur	5,77	5,39
Mobile Telekommunikationsdienste	4,67	4,36
Sonstige Sektoren	30,46	28,47
<b>GESAMT</b>	<b>84,25</b>	<b>78,69</b>

## AUFTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE NACH HERKUNFTSLAND

Land	Prozentualer Anteil	
	Nettovermögen	Vermögen insgesamt
DEUTSCHLAND	28,19	26,33
FRANKREICH	23,36	21,82
ITALIEN	10,34	9,66
Sonstige Länder	22,36	20,88
<b>GESAMT</b>	<b>84,25</b>	<b>78,69</b>

## VERÄNDERUNG DES WERTPAPIERBESTANDS IM BERICHTSZEITRAUM

Bestandteile des Wertpapierportfolios	Veränderungen (Betrag)	
	Käufe	Verkäufe
a) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gemäß Artikel L. 422-1 des Code Monétaire et Financier gehandelt werden	14.957.864,06	32.420.272,24
b) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt gehandelt werden, der sich in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder einem anderen Staat befindet, der dem Europäischen Wirtschaftsraum angehört	0,00	0,00
c) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittstaats zugelassen sind oder an einem anderen geregelten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt eines Drittstaats gehandelt werden, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht auf einer von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde veröffentlichten Liste steht oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Markts per Gesetz oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,00	239.137,00
d) In Artikel R. 214-11, Abschnitt I, Absatz 4 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) aufgeführte neu emittierte Finanztitel	0,00	0,00
e) Sonstige Vermögenswerte: Es handelt sich um die in Artikel R. 214-11, Abschnitt II des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) aufgeführten Vermögenswerte	9.501.125,00	3.563.310,00

Veränderungen im Berichtszeitraum	Veränderungen (Betrag)
Käufe	24.458.989,06
Verkäufe	36.222.719,24

## AUSSCHÜTTUNGEN IM BERICHTSZEITRAUM

Entfällt

**BESTANDSVERZEICHNIS**

Wertpapierbezeichnung	Wahrung	Menge Anzahl oder Nennwert	Borsenwert	% des Netto- vermogens
Airbus SE 0% Conv DassAvia EMTN Reg S Sen 16/14.06.21	EUR	2.200.000	2.356.420,00	2,69
Corporacion Economica Damm SA 1% Conv EbroFood 16/01.12.23	EUR	1.200.000	1.191.415,97	1,36
Prysmian SpA 0% Conv Reg S Ser PRYI 17/17.01.22	EUR	1.600.000	1.592.664,00	1,82
Archer Obligations SA 0% Conv Kering Ser KER Sen 17/31.03.23	EUR	700.000	1.039.783,50	1,19
Deutsche Wohnen SE 0.6% Conv Sen Reg S 17/05.01.26	EUR	2.900.000	3.074.325,16	3,52
RAG-Stiftung 0% Conv Evonilnd Re Sen Reg S 18/02.10.24	EUR	600.000	614.817,00	0,70
Almirall SA 0.25% Sen Conv 18/14.12.21	EUR	600.000	621.780,97	0,71
Orpea SA 0.375% Conv Sen Reg S 19/17.05.27	EUR	17.700	2.877.887,25	3,29
Edenred SA 0% Conv Sen Reg S 19/06.09.24	EUR	28.800	1.911.340,80	2,19
UBISOFT Entertainment SA 0% Conv UBI Sen Reg S 19/24.09.24	EUR	10.500	1.260.908,25	1,44
RAG-Stiftung 0% EMTN Conv Evonik Indust AG Reg S 15/18.02.21	EUR	1.500.000	1.539.765,00	1,76
Telecom Italia SpA 1.125% Conv Sen 15/26.03.22	EUR	7.400.000	7.454.536,17	8,52
Ingenico Group SA 0% Conv Reg S Sen 15/26.06.22	EUR	7.000	1.205.169,00	1,38
Iberdrola Intl BV 0% Conv Reg S Iberdrola SA 15/11.11.22	EUR	2.400.000	2.777.064,00	3,18
Total SA 0.5% Conv Ser FP 15/02.12.22	USD	1.400.000	1.326.359,47	1,52
Grand City Properties SA VAR Conv Reg S Ser F 16/02.03.22	EUR	1.600.000	1.710.415,65	1,96
Remgro Jersey GBP Ltd 2.625% Conv MedIntl 16/22.03.21	GBP	1.200.000	1.421.776,26	1,63
Citigroup GI Mks Fd Lux SCA 0.5% Conv Ser TKA 16/04.08.23	EUR	600.000	677.528,67	0,77
Fresenius SE & Co KGaA 0% Conv 17/31.01.24	EUR	2.200.000	2.171.983,00	2,48
Deutsche Wohnen SE 0.325% Conv Sen Reg S 17/26.07.24	EUR	2.900.000	3.066.690,97	3,51
RAG-Stiftung 0% Conv Evonilnd Re Sen Reg S 17/16.03.23	EUR	1.700.000	1.765.722,00	2,02
Bayer AG 0.05% Conv Covestro Ser 1COV Sen Reg S 17/15.06.20	EUR	2.600.000	2.600.002,49	2,97
ORPAR 0% Conv RemCoint Reg S 17/20.06.24	EUR	1.100.000	1.138.527,50	1,30
TAG Immobilien AG 0.625% Conv Sen Reg S 17/01.09.22	EUR	500.000	630.534,56	0,72
LEG Immobilien AG 0.875% Sen Reg S Conv 17/01.09.25	EUR	2.500.000	2.903.589,42	3,32
CA-Immobilien-Anlagen AG 0.75% Conv Sen 17/04.04.25	EUR	500.000	658.607,38	0,75
Elis SA 0% Conv Ser Elis Sen Reg S 17/06.10.23	EUR	27.300	879.578,70	1,01
Corestate Capital Holding SA 1.375% Conv Sen 17/28.11.22	EUR	600.000	520.748,93	0,60
BE Semiconductor Industries NV 0.5% Conv Sen 17/06.12.24	EUR	1.000.000	1.017.280,00	1,16
Deutsche Post AG 0.05% Conv Sen Reg S 17/30.06.25	EUR	3.200.000	3.277.323,80	3,75
Cellnex Telecom SA 1.5% Conv EMTN Sen Reg S 18/16.01.26	EUR	2.600.000	3.521.168,96	4,03
Nexity 0.25% Conv Sen 18/02.03.25	EUR	20.700	1.441.496,25	1,65
Sika AG 0.15% Conv Sen Reg S 18/05.06.25	CHF	1.000.000	1.074.380,65	1,23
SAFRAN SA 0% Conv Sen Reg S 18/21.06.23	EUR	18.000	2.922.561,00	3,34
Silicon On Insulator Tec 0% Conv Soitec Sen Reg S 8/28.06.23	EUR	3.000	362.158,50	0,41
Adidas AG 0.05% Conv Sen Reg S 18/12.09.23	EUR	1.000.000	1.229.584,37	1,41
Qiagen NV 1% Conv Sen Reg S 18/13.11.24	USD	800.000	729.508,43	0,83
Air France KLM 0.125% Conv Sen Reg S 19/25.03.26	EUR	117.000	2.136.361,50	2,44
GN Store Nord Ltd 0% Conv Sen Reg S 19/21.05.24	EUR	700.000	712.201,00	0,81
Cellnex Telecom SA 0.5% Conv EMTN 19/05.07.28	EUR	500.000	559.000,67	0,64
Worldline SA 0% Conv Sen Reg S 19/30.07.26	EUR	12.174	1.330.143,41	1,52
MTU Aero Engines AG 0.05% Conv Sen Reg S 19/18.03.27	EUR	2.200.000	2.394.493,58	2,74
Atos SE 0% Conv Worldlin Sen Reg S 19/06.11.24	EUR	500.000	598.177,50	0,68
<b>GESAMT An einem geregelten oder gleichwertigen Markt gehandelte Anleihen und ahnliche Wertpapiere</b>			<b>74.295.781,69</b>	<b>84,95</b>

In Form einer Vereinfachten Aktiengesellschaft franzosischen Rechts („Societ Anonyme Simplifie“) errichtete Portfolioverwaltungsgesellschaft mit einem Kapital von 7.500.000 EUR.  
 Zugelassen von der franzosischen Finanzmarktaufsichtsbehorde („Autorit des Marchs Financiers“) unter der Nr. GP 99011 – RCS 340 902 857 Paris  
 12, boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Frankreich  
 Tel.: 33 (0)1 44 51 85 00 – [www.am.oddo-bhf.com](http://www.am.oddo-bhf.com)



Wertpapierbezeichnung	Währung	Menge Anzahl oder Nennwert	Börsenwert	% des Netto- vermö- gens
<b>GESAMT Anleihen &amp; ähnliche Wertpapiere</b>			<b>74.295.781,69</b>	<b>84,95</b>
Oddo BHF Jour CI EUR Cap	EUR	2.500	5.933.725,00	6,78
<b>GESAMT allgemeine OGAW und AIF</b>			<b>5.933.725,00</b>	<b>6,78</b>
<b>GESAMT Nicht professionellen Kunden vorbehaltene allgemeine Investmentfonds und vergleichbare Produkte aus anderen Mitgliedstaaten der EU</b>			<b>5.933.725,00</b>	<b>6,78</b>
<b>GESAMT OGA-Anteile</b>			<b>5.933.725,00</b>	<b>6,78</b>
Diverse Kreditoren Z/R EUR	EUR	-30.455,36	-30.455,36	-0,03
<b>GESAMT Sonstige Verbindlichkeiten und Forderungen</b>			<b>-30.455,36</b>	<b>-0,03</b>
<b>GESAMT Verbindlichkeiten und Forderungen</b>			<b>-30.455,36</b>	<b>-0,03</b>
OddoCie CHF	CHF	12.734,94	11.721,75	0,01
OddoCie EUR	EUR	4.278.373,09	4.278.373,09	4,90
OddoCie GBP	GBP	978	1.154,14	0,00
OddoCie USD	USD	7.655,65	6.818,96	0,01
<b>GESAMT Vermögenswerte</b>			<b>4.298.067,94</b>	<b>4,92</b>
V/A CHF EUR 150120	EUR	1.051.897,25	1.051.897,25	1,20
V/A CHF EUR 150120	CHF	-1.153.500	-1.061.919,37	-1,21
V/A USD EUR 150120	EUR	2.099.217,83	2.099.217,83	2,40
V/A USD EUR 150120	USD	-2.343.000	-2.085.266,48	-2,38
V/A GBP EUR 150120	EUR	1.415.373,74	1.415.373,74	1,62
V/A GBP EUR 150120	GBP	-1.200.000	-1.415.532,42	-1,62
H A/V CHF EUR 150120	EUR	1.115.000	1.026.476,02	1,17
H A/V CHF EUR 150120	CHF	-1.016.978,15	-1.016.978,15	-1,16
H A/V CHF EUR 150120	EUR	545.500	502.190,74	0,57
H A/V CHF EUR 150120	CHF	-497.544,02	-497.544,02	-0,57
<b>GESAMT Termingeschäfte</b>			<b>17.915,14</b>	<b>0,02</b>
TERM FIX 0.01 181220	EUR	2.000.000	2.000.007,22	2,29
TERM FIX 0.01 181220	EUR	1.000.000	1.000.003,61	1,14
<b>GESAMT Termineinlagen</b>			<b>3.000.010,83</b>	<b>3,43</b>
ADM OTC - SOGENE EUR	EUR	10.000	10.000,00	0,01
<b>GESAMT Sonstige liquide Mittel</b>			<b>10.000,00</b>	<b>0,01</b>
<b>GESAMT Liquide Mittel</b>			<b>7.325.993,91</b>	<b>8,38</b>
Verwaltungsgebühr	CHF	-1.102,34	-1.014,64	-0,01
Verwaltungsgebühr	EUR	-65.216,24	-65.216,24	-0,07
<b>GESAMT Kosten</b>			<b>-66.230,88</b>	<b>-0,08</b>
<b>GESAMT Kosten</b>			<b>-66.230,88</b>	<b>-0,08</b>
<b>GESAMT Kosten</b>			<b>-66.230,88</b>	<b>-0,08</b>
<b>GESAMT BARMITTEL</b>			<b>7.229.307,67</b>	<b>8,27</b>
<b>GESAMT Positionen in vollständigem Eigentum</b>			<b>-12,06</b>	<b>0,00</b>
<b>GESAMT Vertragliche Verkaufsgeschäfte</b>			<b>-12,06</b>	<b>0,00</b>
<b>GESAMT Vertragliche Geschäfte</b>			<b>-12,06</b>	<b>0,00</b>
<b>GESAMT NETTOVERMÖGEN</b>			<b>87.458.802,30</b>	<b>100,00</b>

## **ODDO BHF EUROPEAN CONVERTIBLES MODERATE**

### **Securities Financing Transactions Regulation**

**31.12.2019**

**EUR**

In Form einer Vereinfachten Aktiengesellschaft französischen Rechts („Société Anonyme Simplifiée“) errichtete Portfolioverwaltungsgesellschaft mit einem Kapital von 7.500.000 EUR.

Zugelassen von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde („Autorité des Marchés Financiers“) unter der Nr. GP 99011 – RCS 340 902 857 Paris

12, boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Frankreich

Tel.: 33 (0)1 44 51 85 00 – [www.am.oddo-bhf.com](http://www.am.oddo-bhf.com)

**Betrag der Vermögenswerte, die bei den einzelnen Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps eingesetzt worden sind, ausgedrückt als absoluter Betrag und in Prozent des Nettofondsvermögens**

	Verliehene Wertpapiere	Entliehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
Summe					
% des Nettogesamtvermögens					

**Betrag der verliehenen Wertpapiere und Waren, ausgedrückt als Anteil an den Vermögenswerten**

	Verliehene Wertpapiere	Entliehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
Betrag der verliehenen Vermögenswerte					
% der verleihbaren Vermögenswerte					

**Die zehn wichtigsten Emittenten von erhaltenen Sicherheiten (ohne liquide Mittel) für alle Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (aufgeschlüsselt nach Volumen der Sicherheiten für laufende Vereinbarungen)**

1. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
2. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
3. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
4. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
5. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
6. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
7. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
8. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
9. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	
10. Name	
Volumen der erhaltenen Sicherheiten	

In Form einer Vereinfachten Aktiengesellschaft französischen Rechts („Société Anonyme Simplifiée“) errichtete Portfolioverwaltungsgesellschaft mit einem Kapital von 7.500.000 EUR.

Zugelassen von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde („Autorité des Marchés Financiers“) unter der Nr. GP 99011 – RCS 340 902 857 Paris

12, boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Frankreich

Tel.: 33 (0)1 44 51 85 00 – [www.am.oddo-bhf.com](http://www.am.oddo-bhf.com)

**Die zehn wichtigsten Gegenparteien als absoluter Wert der Aktiva und Passiva ohne Clearing**

	Verliehene Wertpapiere	Entlehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
1. Name					
Summe					
Sitz					
2. Name					
Summe					
Sitz					
3. Name					
Summe					
Sitz					
4. Name					
Summe					
Sitz					
5. Name					
Summe					
Sitz					
6. Name					
Summe					
Sitz					
7. Name					
Summe					
Sitz					
8. Name					
Summe					
Sitz					
9. Name					
Summe					
Sitz					
10. Name					
Summe					
Sitz					

## Art und Qualität der Sicherheiten

	Verliehene Wertpapiere	Entliehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
<b>Art und Qualität der Sicherheit</b>					
<b>Liquide Mittel</b>					
<b>Schuldinstrumente</b>					
Hohes Rating					
Mittleres Rating					
Niedriges Rating					
<b>Aktien</b>					
Hohes Rating					
Mittleres Rating					
Niedriges Rating					
<b>Fondsanteile</b>					
Hohes Rating					
Mittleres Rating					
Niedriges Rating					
<b>Währung der Sicherheit</b>					
<b>Land des Emittenten der Sicherheit</b>					

## Laufzeit der Sicherheiten, aufgeschlüsselt nach den folgenden Zeitspannen:

	Verliehene Wertpapiere	Entliehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
weniger als 1 Tag					
1 Tag bis 1 Woche					
1 Woche bis 1 Monat					
1 bis 3 Monate					
3 Monate bis 1 Jahr					
mehr als 1 Jahr					
offen					

### Laufzeit der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps, aufgeschlüsselt nach den folgenden Zeitspannen:

	Verleihte Wertpapiere	Entlehnte Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
weniger als 1 Tag					
1 Tag bis 1 Woche					
1 Woche bis 1 Monat					
1 bis 3 Monate					
3 Monate bis 1 Jahr					
mehr als 1 Jahr					
offen					

### Abwicklung und Clearing von Kontrakten

	Verleihte Wertpapiere	Entlehnte Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
Zentrale Gegenpartei					
Bilateral					
Trilateral					

### Daten zur Weiterverwendung der Sicherheiten

	Barsicherheiten	Titel
Höchstbetrag (%)		
Verwendeter Betrag (%)		
Rendite des OGA aus der Wiederanlage der Barsicherheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps		

### Daten zur Verwahrung der dem OGA bereitgestellten Sicherheiten

1. Name

Verwahrter Betrag


## Daten zur Verwahrung der vom OGA gestellten Sicherheiten

Gesamtbetrag der gestellten Sicherheiten

In % aller gestellten Sicherheiten

Getrennte Konten  
 Zusammengefasste Konten  
 Sonstige Konten


## Aufschlüsselung der Renditen

	Verliehene Wertpapiere	Entlehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
<b>OGA</b>					
Summe					
in % der Rendite					
<b>Fondsmanager</b>					
Summe					
in % der Rendite					
<b>Dritte (z.B. Leihstelle)</b>					
Summe					
in % der Rendite					

## Aufschlüsselung der Kosten

	Verliehene Wertpapiere	Entlehene Wertpapiere	Inpensionsgaben	Inpensionsnahmen	Total Return Swap
<b>OGA</b>	61,03			69,18	
Summe					
<b>Fondsmanager</b>					
Summe					
<b>Dritte (z.B. Leihstelle)</b>					
Summe					