



Arrêté Semestriel au 31 décembre 2019

Oddo BHF European Convertibles Moderate

Fonds Commun de Placement de Droit Français

Le prospectus de vente détaillé, des documents intitulés "Informations clés pour l'investisseur", les statuts, les rapports annuels et semestriels sont disponibles sans frais auprès du Représentant et Service de Paiement pour la Suisse, RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, succursale de Zurich, Bleicherweg 7, CH-8027 Zurich. La liste des variations du portefeuille est gratuitement à la disposition de l'investisseur auprès du représentant pour la Suisse.

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

ETAT DU PATRIMOINE

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-24-55 du code monétaire et financier	74 295 781,69
b) Avoirs bancaires	4 298 067,94
c) Autres actifs détenus par le FIA	15 038 891,41
d) Total des actifs détenus par le FIA	93 632 741,04
e) Passif	-6 173 938,74
f) Valeur nette d'inventaire	87 458 802,30

* Les montants sont signés

NOMBRE DE PARTS OU D'ACTIONS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur liquidative
OdConvEM CR C	Capitalisation	51 737 224,78	320 486,78	161,43
OddEuCoM CI C	Capitalisation	31 018 435,37	25 840,89	1 200,36
OdConvEM GC C	Capitalisation	1 028 149,32	9 980,38	103,01
OdConvEM CR Hg C	Capitalisation	503 541,48	5 942,00	84,74
OdConvEM CI Hg C	Capitalisation	1 029 342,74	1 118,00	920,70
OdConvEM CRe C	Capitalisation	45 825,77	471,08	97,27
OdConvEM CN C	Capitalisation	2 096 282,84	20 129,44	104,14

ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier	83,50	77,99
b) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen	0,00	0,00
c) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	0,75	0,70
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs : il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	6,78	6,34

REPARTITION DES ACTIFS PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
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

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
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
TOTAL	EUR	69 128 939,88	79,04	73,82
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
TOTAL	USD	2 055 867,90	2,35	2,20
Remgro Jersey GBP Ltd 2.625% Conv MediIntl 16/22.03.21	GBP	1 421 776,26	1,63	1,52
TOTAL	GBP	1 421 776,26	1,63	1,52
Sika AG 0.15% Conv Sen Reg S 18/05.06.25	CHF	1 074 380,65	1,23	1,15
TOTAL	CHF	1 074 380,65	1,23	1,15
TOTAL		73 680 964,69	84,25	78,69

REPARTITION DES ACTIFS PAR SECTEUR ECONOMIQUE

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Gestion et promotion immobilière	17,39	16,21
Industrie aérospatiale et défense	8,77	8,20
Autres services financiers	8,67	8,10
Services de télécommunication intégrés	8,52	7,96
Infrastructures médicales	5,77	5,39
Services de télécommunication mobile	4,67	4,36
Autres secteurs	30,46	28,47
TOTAL	84,25	78,69

REPARTITION DES ACTIFS PAR PAYS DE RESIDENCE

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
ALLEMAGNE	28,19	26,33
FRANCE	23,36	21,82
ITALIE	10,34	9,66
Autres pays	22,36	20,88
TOTAL	84,25	78,69

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
a) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier	14 957 864,06	32 420 272,24
b) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen	0,00	0,00
c) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	0,00	239 137,00
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs : il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	9 501 125,00	3 563 310,00

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	24 458 989,06
Cessions	36 222 719,24

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

Néant

INVENTAIRE

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur boursière	% Actif Net
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 Medilntl 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
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			74 295 781,69	84,95
TOTAL Obligations & Valeurs assimilées			74 295 781,69	84,95
Oddo BHF Jour CI EUR Cap	EUR	2 500	5 933 725,00	6,78
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale			5 933 725,00	6,78

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur boursière	% Actif Net
TOTAL Fonds d investissement à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d autres Etats membres de l UE			5 933 725,00	6,78
TOTAL Titres d OPC			5 933 725,00	6,78
CdtDiv S/R EUR	EUR	-30 455,36	-30 455,36	-0,03
TOTAL Autres dettes et créances			-30 455,36	-0,03
TOTAL Dettes et créances			-30 455,36	-0,03
OddoCie Par- CHF	CHF	12 734,94	11 721,75	0,01
OddoCie Par- EUR	EUR	4 278 373,09	4 278 373,09	4,90
OddoCie Par- GBP	GBP	978	1 154,14	0,00
OddoCie Par- USD	USD	7 655,65	6 818,96	0,01
TOTAL Avoirs			4 298 067,94	4,92
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
TOTAL Opérations à terme			17 915,14	0,02
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
TOTAL Depots a terme			3 000 010,83	3,43
ADM OTC - SOGENE EUR	EUR	10 000	10 000,00	0,01
TOTAL Autres disponibilités			10 000,00	0,01
TOTAL disponibilités			7 325 993,91	8,38
Cion de gestion	CHF	-1 102,34	-1 014,64	-0,01
Cion de gestion	EUR	-65 216,24	-65 216,24	-0,07
TOTAL Frais			-66 230,88	-0,08
TOTAL Frais			-66 230,88	-0,08
TOTAL Frais			-66 230,88	-0,08
TOTAL TRESORERIE			7 229 307,67	8,27
TOTAL Lignes détenus en pleine propriété			-12,06	0,00
TOTAL Opération contractuelle a la vente			-12,06	0,00
TOTAL Opérations contractuelles			-12,06	0,00
TOTAL ACTIF NET			87 458 802,30	100,00

BILAN ACTIF AU 28/06/2019 EN EUR

	28/06/2019	29/06/2018
Immobilisations nettes	0,00	0,00
Dépôts	6 290 189,90	10 398 629,50
Instruments financiers	90 978 042,87	138 591 336,15
Actions et valeurs assimilées	0,00	0,00
Négoziées sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Non négociées sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Obligations et valeurs assimilées	87 668 402,11	108 278 242,19
Négoziées sur un marché réglementé ou assimilé	87 668 402,11	108 278 242,19
Non négociées sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Titres de créances	3 172 015,78	0,00
Négoziés sur un marché réglementé ou assimilé	3 172 015,78	0,00
<i>Titres de créances négociables</i>	0,00	0,00
<i>Autres titres de créances</i>	3 172 015,78	0,00
Non négociés sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Organismes de placement collectif	0,00	13 332 214,00
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	0,00	13 332 214,00
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'Union européenne	0,00	0,00
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'union européenne et organismes de titrisations cotés	0,00	0,00
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'union européenne et organismes de titrisations non cotés	0,00	0,00
Opérations temporaires sur titres	36 996,98	16 468 360,96
Créances représentatives de titres financiers reçus en pension	36 996,98	0,00
Créances représentatives de titres financiers prêtés	0,00	11 091 433,19
Titres financiers empruntés	0,00	0,00
Titres financiers donnés en pension	0,00	5 376 927,77
Autres opérations temporaires	0,00	0,00
Contrats financiers		
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	100 628,00	512 519,00
Autres opérations	0,00	0,00
Autres instruments financiers	0,00	0,00
Créances	18 247 204,14	44 158 182,12
Opérations de change à terme de devises	17 235 538,03	41 996 700,98
Autres	1 011 666,11	2 161 481,14
Comptes financiers	9 084 644,85	18 400 453,98
Liquidités	9 084 644,85	18 400 453,98
Total de l'actif	124 600 081,76	211 548 601,75

COMPTE DE RESULTAT AU 28/06/2019 EN EUR

	28/06/2019	29/06/2018
Produits sur opérations financières		
Produits sur dépôts et sur comptes financiers	739,07	157,50
Produits sur actions et valeurs assimilées	0,00	0,00
Produits sur obligations et valeurs assimilées	490 898,39	2 263 574,13
Produits sur titres de créances	31 550,69	188 267,66
Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	106 913,21	221 912,50
Produits sur contrats financiers	0,00	0,00
Autres produits financiers	187,83	1 292,62
TOTAL (I)	630 289,19	2 675 204,41
Charges sur opérations financières		
Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	1 010,84	4 036,39
Charges sur contrats financiers	0,00	0,00
Charges sur dettes financières	110,43	773,14
Autres charges financières	0,00	0,00
TOTAL (II)	1 121,27	4 809,53
Résultat sur opérations financières (I - II)	629 167,92	2 670 394,88
Autres produits (III)	0,00	0,00
Frais de gestion et dotations aux amortissements (IV)	1 048 290,40	2 454 099,90
Résultat net de l'exercice (L. 214-17-1) (I - II + III - IV)	-419 122,48	216 294,98
Régularisation des revenus de l'exercice (V)	87 014,26	11 325,74
Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (VI)	0,00	0,00
Résultat (I - II + III - IV +/- V - VI)	-332 108,22	227 620,72

Part	Performance annuelle (*)	Indicateur de référence	Performance annualisée depuis 5 ans	Performance annualisée depuis création	Date de création	TER (**)	SURPERFORMANCE
ODDO BHF European Convertibles Moderate CI-CHF [H]	6.25%	7.57%		0.01%	14/01/2015	0.65	-
ODDO BHF EUROPEAN CONVERTIBLES MODERATE CI-EUR	6.66%		0.48%	2.51%	16/08/2012	0.65	-
ODDO BHF EUROPEAN CONVERTIBLES MODERATE CN-EUR	6.56%		-	3.70%	19/11/2018	0.75	-
ODDO BHF European Convertibles Moderate CR-CHF [H]	5.84%		-	-1.76%	06/05/2015	1.00	-
ODDO BHF EUROPEAN CONVERTIBLES MODERATE CR-EUR	6.29%		0.13%	2.51%	14/09/2000	1.00	-
ODDO BHF EUROPEAN CONVERTIBLES MODERATE CR-EUR	5.65%		-	-0.77%	31/05/2016	1.60	-
ODDO BHF EUROPEAN CONVERTIBLES MODERATE GC-EUR	6.66%		0.48%	0.54%	30/06/2014	0.65	-

(*) La performance historique ne représente pas un indicateur de performance courante ou future et les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais perçus lors de l'émission et du rachat des parts.

(**) Y compris bonification en dépendance de la performance

ODDO BHF EUROPEAN CONVERTIBLES MODERATE

Securities Financing Transactions Regulation

31/12/2019

EUR

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

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
Montant					
% de l'actif net total					

Montant des titres et matières premières prêtés en proportion des actifs

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

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

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

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

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
1. Nom					
Montant					
Domicile					
2. Nom					
Montant					
Domicile					
3. Nom					
Montant					
Domicile					
4. Nom					
Montant					
Domicile					
5. Nom					
Montant					
Domicile					
6. Nom					
Montant					
Domicile					
7. Nom					
Montant					
Domicile					
8. Nom					
Montant					
Domicile					
9. Nom					
Montant					
Domicile					
10. Nom					
Montant					
Domicile					

Type et qualité des garanties (collatéral)

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

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

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

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

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

Règlement et compensation des contrats

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

Données sur la réutilisation des garanties

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

Données sur la conservation des garanties reçues par l'OPC

1. Nom

Montant conservé

Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Montant total du collatéral versé	
En % de toutes les garanties versées	
Comptes séparés	
Comptes groupés	
Autres comptes	

Données sur les revenus ventilés

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

Données sur les coûts ventilés

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
OPC	61.03			69.18	
Montant					
Gestionnaire					
Montant					
Tiers (ex. agent prêteur...)					
Montant					