



Semestre cerrado a 31 de diciembre de 2021

Oddo BHF Sustainable European Convertibles

Fondo de inversión colectiva (FCP) de derecho francés

EL DOCUMENTO DE INFORMACIÓN SEMESTRAL NO ES OBJETO DE CERTIFICACIÓN POR PARTE DEL AUDITOR DEL OICVM

BALANCE

| Partidas del Balance | Importe a la fecha del cierre periódico* |
|---|--|
| a) Títulos financieros aptos mencionados en el punto 1, apartado I, del artículo L. 214-24-55 del Código Monetario y Financiero francés | 80.022.806,27 |
| b) Activos bancarios | 7.697.320,38 |
| c) Otros activos del fondo de inversión alternativo | 17.099.786,52 |
| d) Total de los activos del fondo de inversión alternativo | 104.819.913,17 |
| e) Pasivo | -8.084.013,87 |
| f) Valor liquidativo | 96.735.899,30 |

* Los importes están certificados

NÚMERO DE PARTICIPACIONES O ACCIONES EN CIRCULACIÓN Y VALOR LIQUIDATIVO

| Participación | Clase de participaciones | Patrimonio neto por participación | Número de participaciones en circulación | Valor liquidativo |
|------------------|--------------------------|-----------------------------------|--|-------------------|
| OddSEuCo CR C | Capitalización | 62.046.721,69 | 369.985,215 | 167,70 |
| OddSEuCo CI C | Capitalización | 27.878.358,50 | 22.201,135 | 1.255,71 |
| OddSEuCo GC C | Capitalización | 2.575.931,93 | 23.903,87 | 107,76 |
| OddSEuCo CI Hg C | Capitalización | 823.751,50 | 820,00 | 1.004,57 |
| OddSEuCo CRe C | Capitalización | 19.589,01 | 196,179 | 99,85 |
| OddSEuCo CN C | Capitalización | 3.386.864,59 | 31.150,365 | 108,72 |
| OddSEuCo DR Di | Distribución | 4.682,08 | 47,143 | 99,31 |

ELEMENTOS DE LA CARTERA DE VALORES

| Elementos de la cartera de valores: | Porcentaje | |
|--|-----------------|----------------------|
| | Patrimonio neto | Total de los activos |
| a) Los títulos financieros aptos y los instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un mercado organizado en el sentido del artículo L. 422-1 del Código Monetario y Financiero francés | 82,72 | 76,34 |
| b) Los títulos financieros aptos y los instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en otro mercado organizado, en funcionamiento de forma regular, reconocido y abierto al público, cuyo domicilio se encuentre en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado que participe en el Acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo | 0,00 | 0,00 |
| c) Los títulos financieros aptos y los instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado de un país tercero, organizado, en funcionamiento de forma regular, reconocido y abierto al público, siempre y cuando dicha bolsa o dicho mercado no figuren en lista alguna elaborada por la Autorité des Marchés Financiers o la elección de estos se prevea en la ley, en la normativa o en los estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios | 0,00 | 0,00 |
| d) Los títulos financieros emitidos recientemente y mencionados en el punto 4, apartado I, del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero francés | 0,00 | 0,00 |
| e) Los demás activos: se trata de activos mencionados en el apartado II del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero francés | 0,00 | 0,00 |

DISTRIBUCIÓN DE LOS ACTIVOS POR DIVISA

| Títulos | Divisa | Importe (EUR) | Porcentaje | |
|--|--------|---------------|-----------------|----------------------|
| | | | Patrimonio neto | Total de los activos |
| Cellnex Telecom SA 1.5% Conv EMTN Sen Reg S 18/16.01.26 | EUR | 4.412.292,12 | 4,56 | 4,21 |
| Amadeus IT Group SA 1.5% Conv 20/09.04.25 | EUR | 3.783.304,46 | 3,91 | 3,61 |
| Worldline SA 0% Conv Sen Reg S 19/30.07.26 | EUR | 3.730.081,00 | 3,86 | 3,56 |
| SAFRAN SA 0.875% Conv Sen Reg S 20/15.05.27 | EUR | 3.706.938,00 | 3,83 | 3,54 |
| SAFRAN SA 0% Conv 21/01.04.28 | EUR | 3.588.990,00 | 3,71 | 3,42 |
| RAG-Stiftung 0% Conv EvoniInd Re Sen Reg S 20/17.06.26 | EUR | 2.960.100,00 | 3,06 | 2,82 |
| Nexi SpA 1.75% Conv Sen Reg S 20/24.04.27 | EUR | 2.911.133,00 | 3,01 | 2,78 |
| Deutsche Post AG 0.05% Conv Sen Reg S 17/30.06.25 | EUR | 2.880.924,33 | 2,98 | 2,75 |
| Archer Obligations SA 0% Conv Kering Ser KER Sen 17/31.03.23 | EUR | 2.762.008,00 | 2,86 | 2,64 |
| Veolia Environnement 0% Conv Sen Reg S 19/01.01.25 | EUR | 2.697.006,00 | 2,79 | 2,57 |
| LEG Immobilien SE 0.875% Sen Reg S Conv 17/01.09.25 | EUR | 2.678.316,10 | 2,77 | 2,56 |
| Electricité de France SA 0% Conv 20/14.09.24 | EUR | 2.630.360,00 | 2,72 | 2,51 |
| Orpea SA 0.375% Conv Sen Reg S 19/17.05.27 | EUR | 2.467.421,25 | 2,55 | 2,35 |
| Zalando SE 0.05% Conv Tr A Sen Reg S 20/06.08.25 | EUR | 2.405.737,07 | 2,49 | 2,30 |
| Iberdrola Intl BV 0% Conv Reg S Iberdrola SA 15/11.11.22 | EUR | 2.401.020,50 | 2,48 | 2,29 |
| Korian SA 0.875% Conv Sen Reg S 20/06.03.27 | EUR | 2.126.334,50 | 2,20 | 2,03 |
| Nexity 0.25% Conv Sen 18/02.03.25 | EUR | 2.019.435,00 | 2,09 | 1,93 |
| Accor SA 0.7% Conv Sen 20/07.12.27 | EUR | 1.822.380,00 | 1,88 | 1,74 |
| UBISOFT Entertainment SA 0% Conv UBI Sen Reg S 19/24.09.24 | EUR | 1.672.126,20 | 1,73 | 1,60 |
| Soitec 0% Conv Sen Reg S 20/01.10.25 | EUR | 1.570.531,20 | 1,62 | 1,50 |
| Atos SE 0% Conv Worldlin Sen Reg S 19/06.11.24 | EUR | 1.498.658,00 | 1,55 | 1,43 |
| Nexi SpA 0% Conv 21/24.02.28 | EUR | 1.414.057,50 | 1,46 | 1,35 |
| Selena Sàrl 0% Conv Puma Sen Reg S 20/25.06.25 | EUR | 1.403.484,50 | 1,45 | 1,34 |
| Just Eat Takeaway.com NV 1.25% Conv Sen Reg S 20/30.04.26 | EUR | 1.356.842,23 | 1,40 | 1,29 |
| ORPAR 0% Conv RemCoint Reg S 17/20.06.24 | EUR | 1.346.679,00 | 1,39 | 1,28 |
| TAG Immobilien AG 0.625% Conv 20/27.08.26 | EUR | 1.332.997,74 | 1,38 | 1,27 |
| Intl Consolidated Air Gr SA 1.125% Conv 21/18.05.28 | EUR | 1.285.054,86 | 1,33 | 1,23 |
| MTU Aero Engines AG 0.05% Conv Sen Reg S 19/18.03.27 | EUR | 1.157.904,00 | 1,20 | 1,10 |
| Just Eat Takeaway.com NV 2.25% Conv Sen Reg S 19/25.01.24 | EUR | 1.068.361,03 | 1,10 | 1,02 |
| BE Semiconductor Industries NV 0.75% Conv Sen 20/05.08.27 | EUR | 977.803,70 | 1,01 | 0,93 |
| RAG-Stiftung 0% Conv EvoniInd Re Sen Reg S 17/16.03.23 | EUR | 930.775,50 | 0,96 | 0,89 |
| RAG-Stiftung 0% Conv EvoniInd Re Sen Reg S 18/02.10.24 | EUR | 926.946,00 | 0,96 | 0,88 |

| Títulos | Divisa | Importe (EUR) | Porcentaje | |
|---|------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| | | | Patrimonio neto | Total de los activos |
| Deutsche Lufthansa AG 2% Conv EMTN Sen 20/17.11.25 | EUR | 738.812,85 | 0,76 | 0,70 |
| Worldline SA 0% Conv Sen 20/30.07.25 | EUR | 738.552,00 | 0,76 | 0,70 |
| Kering 0% Conv PUM Sen Reg S 19/30.09.22 | EUR | 718.569,00 | 0,74 | 0,69 |
| Just Eat Takeaway.com NV 0% Conv 21/09.08.25 | EUR | 701.960,00 | 0,73 | 0,67 |
| Fresenius SE & Co KGaA 0% Conv 17/31.01.24 | EUR | 598.632,00 | 0,62 | 0,57 |
| Zalando SE 0.625% Conv Tr B Sen Reg S 20/06.08.27 | EUR | 443.682,25 | 0,46 | 0,42 |
| Schneider Electric SE 0% Conv 20/15.06.26 | EUR | 317.421,97 | 0,33 | 0,30 |
| TOTAL | EUR | 74.183.632,86 | 76,69 | 70,77 |
| STMicroelectronics NV 0% Conv Ser A Sen 20/04.08.25 | USD | 2.788.131,60 | 2,88 | 2,66 |
| Qiagen NV 0% Conv 20/17.12.27 | USD | 1.700.697,57 | 1,76 | 1,62 |
| Michelin SA 0% Conv 18/10.11.23 | USD | 730.619,28 | 0,76 | 0,70 |
| STMicroelectronics NV 0% Conv Ser B TrB Reg S 20/04.08.27 | USD | 231.577,23 | 0,24 | 0,22 |
| TOTAL | USD | 5.451.025,68 | 5,63 | 5,20 |
| Sika AG 0.15% Conv Sen Reg S 18/05.06.25 | CHF | 388.147,73 | 0,40 | 0,37 |
| TOTAL | CHF | 388.147,73 | 0,40 | 0,37 |
| TOTAL | | 80.022.806,27 | 82,72 | 76,34 |

DISTRIBUCIÓN DE LOS ACTIVOS POR SECTOR ECONÓMICO

| Sector económico | Porcentaje | |
|---|-----------------|----------------------|
| | Patrimonio neto | Total de los activos |
| Servicios financieros diversos | 10,67 | 9,86 |
| Servicios financieros especializados | 9,09 | 8,39 |
| Industria aeronáutica y de defensa | 8,74 | 8,07 |
| Gestión y promoción inmobiliaria | 6,23 | 5,75 |
| Consultoría y servicios de tecnología de la información | 5,46 | 5,04 |
| Establecimientos médicos | 5,37 | 4,95 |
| Otros sectores | 37,16 | 34,28 |
| TOTAL | 82,72 | 76,34 |

DISTRIBUCIÓN DE LOS ACTIVOS POR PAÍS DE RESIDENCIA

| País | Porcentaje | |
|--------------|-----------------|----------------------|
| | Patrimonio neto | Total de los activos |
| FRANCIA | 38,81 | 35,82 |
| ALEMANIA | 17,63 | 16,27 |
| PAÍSES BAJOS | 11,61 | 10,71 |
| Otros países | 14,67 | 13,54 |
| TOTAL | 82,72 | 76,34 |

MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES A LO LARGO DEL PERIODO

| Elementos de la cartera de valores | Movimientos (importe) | |
|--|-----------------------|---------------|
| | Adquisiciones | Ventas |
| a) Los títulos financieros aptos y los instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un mercado organizado en el sentido del artículo L. 422-1 del Código Monetario y Financiero francés | 3.674.851,64 | 25.346.655,63 |
| b) Los títulos financieros aptos y los instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en otro mercado organizado, en funcionamiento de forma regular, reconocido y abierto al público, cuyo domicilio se encuentre en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado que participe en el Acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo | 0,00 | 0,00 |
| c) Los títulos financieros aptos y los instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores o negociados en otro mercado de un país tercero, organizado, en funcionamiento de forma regular, reconocido y abierto al público, siempre y cuando dicha bolsa o dicho mercado no figuren en lista alguna elaborada por la Autorité des Marchés Financiers o la elección de estos se prevea en la ley, en la normativa o en los estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios | 0,00 | 0,00 |
| d) Los títulos financieros emitidos recientemente y mencionados en el punto 4, apartado I, del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero francés | 0,00 | 0,00 |
| e) Los demás activos: se trata de activos mencionados en el apartado II del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero francés | 0,00 | 0,00 |

| Movimientos durante el periodo | Movimientos (importe) |
|--------------------------------|-----------------------|
| Adquisiciones | 3.674.851,64 |
| Ventas | 25.346.655,63 |

DISTRIBUCIÓN A LO LARGO DEL PERIODO

| | Participación € | Importe neto unitario € | Crédito fiscal € | Importe bruto unitario € |
|---|----------------------|-------------------------------|---------------------|--------------------------------|
| Distribución de los resultados | | | | |
| Abonado | | | | |
| Por abonar | | | | |
| Distribución de las plusvalías o minusvalías | | | | |
| Abonado | | | | |
| 10/08/2021 | PARTICIPACIÓN DR-EUR | 3,10 | | 3,10 |
| Por abonar | | | | |

CARTERA

| Denominación de los valores | Divisa | Cantidad o nominal | Valor bursátil | % patrimonio neto |
|--|--------|--------------------|----------------------|-------------------|
| Archer Obligations SA 0% Conv Kering Ser KER Sen 17/31.03.23 | EUR | 1.600.000 | 2.762.008,00 | 2,86 |
| RAG-Stiftung 0% Conv EvonilInd Re Sen Reg S 18/02.10.24 | EUR | 900.000 | 926.946,00 | 0,96 |
| Orpea SA 0.375% Conv Sen Reg S 19/17.05.27 | EUR | 17.500 | 2.467.421,25 | 2,55 |
| Veolia Environnement 0% Conv Sen Reg S 19/01.01.25 | EUR | 71.000 | 2.697.006,00 | 2,79 |
| UBISOFT Entertainment SA 0% Conv UBI Sen Reg S 19/24.09.24 | EUR | 14.800 | 1.672.126,20 | 1,73 |
| Nexi SpA 1.75% Conv Sen Reg S 20/24.04.27 | EUR | 2.600.000 | 2.911.133,00 | 3,01 |
| Iberdrola Intl BV 0% Conv Reg S Iberdrola SA 15/11.11.22 | EUR | 1.900.000 | 2.401.020,50 | 2,48 |
| Fresenius SE & Co KGaA 0% Conv 17/31.01.24 | EUR | 600.000 | 598.632,00 | 0,62 |
| RAG-Stiftung 0% Conv EvonilInd Re Sen Reg S 17/16.03.23 | EUR | 900.000 | 930.775,50 | 0,96 |
| ORPAR 0% Conv RemCoint Reg S 17/20.06.24 | EUR | 900.000 | 1.346.679,00 | 1,39 |
| LEG Immobilien SE 0.875% Sen Reg S Conv 17/01.09.25 | EUR | 2.200.000 | 2.678.316,10 | 2,77 |
| Deutsche Post AG 0.05% Conv Sen Reg S 17/30.06.25 | EUR | 2.400.000 | 2.880.924,33 | 2,98 |
| Michelin SA 0% Conv 18/10.11.23 | USD | 800.000 | 730.619,28 | 0,76 |
| Cellnex Telecom SA 1.5% Conv EMTN Sen Reg S 18/16.01.26 | EUR | 2.500.000 | 4.412.292,12 | 4,55 |
| Nexity 0.25% Conv Sen 18/02.03.25 | EUR | 30.000 | 2.019.435,00 | 2,09 |
| Sika AG 0.15% Conv Sen Reg S 18/05.06.25 | CHF | 200.000 | 388.147,73 | 0,40 |
| Just Eat Takeaway.com NV 2.25% Conv Sen Reg S 19/25.01.24 | EUR | 1.000.000 | 1.068.361,03 | 1,10 |
| Worldline SA 0% Conv Sen Reg S 19/30.07.26 | EUR | 37.000 | 3.730.081,00 | 3,86 |
| MTU Aero Engines AG 0.05% Conv Sen Reg S 19/18.03.27 | EUR | 1.200.000 | 1.157.904,00 | 1,20 |
| Kering 0% Conv PUM Sen Reg S 19/30.09.22 | EUR | 600.000 | 718.569,00 | 0,74 |
| Atos SE 0% Conv Worldlin Sen Reg S 19/06.11.24 | EUR | 1.400.000 | 1.498.658,00 | 1,55 |
| Korian SA 0.875% Conv Sen Reg S 20/06.03.27 | EUR | 37.000 | 2.126.334,50 | 2,20 |
| Just Eat Takeaway.com NV 1.25% Conv Sen Reg S 20/30.04.26 | EUR | 1.500.000 | 1.356.842,23 | 1,40 |
| SAFRAN SA 0.875% Conv Sen Reg S 20/15.05.27 | EUR | 27.000 | 3.706.938,00 | 3,83 |
| RAG-Stiftung 0% Conv EvonilInd Re Sen Reg S 20/17.06.26 | EUR | 2.600.000 | 2.960.100,00 | 3,06 |
| Selena Sàrl 0% Conv Puma Sen Reg S 20/25.06.25 | EUR | 1.100.000 | 1.403.484,50 | 1,45 |
| Worldline SA 0% Conv Sen 20/30.07.25 | EUR | 6.337 | 738.552,00 | 0,76 |
| STMicroelectronics NV 0% Conv Ser A Sen 20/04.08.25 | USD | 2.400.000 | 2.788.131,60 | 2,88 |
| BE Semiconductor Industries NV 0.75% Conv Sen 20/05.08.27 | EUR | 600.000 | 977.803,70 | 1,01 |
| Zalando SE 0.05% Conv Tr A Sen Reg S 20/06.08.25 | EUR | 2.200.000 | 2.405.737,07 | 2,49 |
| STMicroelectronics NV 0% Conv Ser B TrB Reg S 20/04.08.27 | USD | 200.000 | 231.577,23 | 0,24 |
| Zalando SE 0.625% Conv Tr B Sen Reg S 20/06.08.27 | EUR | 400.000 | 443.682,25 | 0,46 |
| TAG Immobilien AG 0.625% Conv 20/27.08.26 | EUR | 1.300.000 | 1.332.997,74 | 1,38 |
| Electricité de France SA 0% Conv 20/14.09.24 | EUR | 190.000 | 2.630.360,00 | 2,72 |
| Soitec 0% Conv Sen Reg S 20/01.10.25 | EUR | 6.400 | 1.570.531,20 | 1,62 |
| Deutsche Lufthansa AG 2% Conv EMTN Sen 20/17.11.25 | EUR | 700.000 | 738.812,85 | 0,76 |
| Schneider Electric SE 0% Conv 20/15.06.26 | EUR | 1.413 | 317.421,97 | 0,33 |
| Accor SA 0.7% Conv Sen 20/07.12.27 | EUR | 35.000 | 1.822.380,00 | 1,88 |
| Qiagen NV 0% Conv 20/17.12.27 | USD | 1.800.000 | 1.700.697,57 | 1,76 |
| Just Eat Takeaway.com NV 0% Conv 21/09.08.25 | EUR | 800.000 | 701.960,00 | 0,73 |
| Nexi SpA 0% Conv 21/24.02.28 | EUR | 1.500.000 | 1.414.057,50 | 1,46 |
| Intl Consolidated Air Gr SA 1.125% Conv 21/18.05.28 | EUR | 1.400.000 | 1.285.054,86 | 1,33 |
| SAFRAN SA 0% Conv 21/01.04.28 | EUR | 20.000 | 3.588.990,00 | 3,71 |
| TOTAL Obligaciones y valores equivalentes negociados en un mercado regulado o equivalente | | | 76.239.501,81 | 78,81 |
| Amadeus IT Group SA 1.5% Conv 20/09.04.25 | EUR | 2.800.000 | 3.783.304,46 | 3,91 |

Sociedad gestora de carteras constituida en forma de sociedad por acciones simplificada (SAS) con un capital de 7.500.000 EUR

Autorizada por la Autorité des Marchés Financiers con el n.º GP 99011 - Inscrita en el Registro Mercantil de París con el n.º 340 902 857

12, boulevard de la Madeleine - 75440 Paris Cedex 09 Francia

Tel.: 33 (0)1 44 51 85 00 - www.am.oddo-bhf.com

| Denominación de los valores | Divisa | Cantidad o nominal | Valor bursátil | % patrimonio neto |
|---|--------|--------------------|----------------------|-------------------|
| TOTAL Oblig. y valores equiv. no negociados en un mercado reg. | | | 3.783.304,46 | 3,91 |
| TOTAL Obligaciones y valores equivalentes | | | 80.022.806,27 | 82,72 |
| ISXE/0322/C/105. | EUR | 295 | 36.875,00 | 0,04 |
| VCA7/0322/C/17. | EUR | 572 | 29.744,00 | 0,03 |
| TOTAL Opciones: operaciones en mercados organizados o equivalentes | | | 66.619,00 | 0,07 |
| TOTAL Opciones | | | 66.619,00 | 0,07 |
| TOTAL Instrumentos financieros a plazo | | | 66.619,00 | 0,07 |
| Acreedores varios S/R EUR | EUR | -10.526,35 | -10.526,35 | -0,01 |
| Deudores varios S/R EUR | EUR | 28,87 | 28,87 | 0,00 |
| TOTAL Otros créditos y deudas | | | -10.497,48 | -0,01 |
| TOTAL Créditos y deudas | | | -10.497,48 | -0,01 |
| OddoCie - CHF | CHF | 65.492,45 | 63.253,44 | 0,07 |
| OddoCie - EUR | EUR | 7.633.348,33 | 7.633.348,33 | 7,89 |
| OddoCie - GBP | GBP | 546,13 | 650,50 | 0,00 |
| OddoCie - USD | USD | 77,43 | 68,11 | 0,00 |
| TOTAL Activos | | | 7.697.320,38 | 7,96 |
| H A/V CHF EUR 140122 | EUR | 855.000 | 825.816,63 | 0,85 |
| H A/V CHF EUR 140122 | CHF | -821.655,42 | -821.655,42 | -0,85 |
| V/A CHF EUR 140122 | EUR | 383.172,85 | 383.172,85 | 0,40 |
| V/A CHF EUR 140122 | CHF | -399.000 | -385.381,10 | -0,40 |
| V/A USD EUR 140122 | EUR | 6.143.423,47 | 6.143.423,47 | 6,36 |
| V/A USD EUR 140122 | USD | -6.948.000 | -6.110.700,50 | -6,32 |
| A/V USD EUR 140122 | EUR | 774.000 | 680.725,70 | 0,70 |
| A/V USD EUR 140122 | USD | -683.639,9 | -683.639,90 | -0,71 |
| TOTAL Operaciones a plazo | | | 31.761,73 | 0,03 |
| TERM FIX 0.00 030122 | EUR | 9.000.000 | 9.000.000,00 | 9,30 |
| TOTAL Depósitos a plazo | | | 9.000.000,00 | 9,30 |
| TOTAL Efectivo | | | 16.729.082,11 | 17,29 |
| Comisión de gestión | CHF | -468,59 | -452,57 | 0,00 |
| Comisión de gestión | EUR | -71.658,03 | -71.658,03 | -0,07 |
| TOTAL Gastos | | | -72.110,60 | -0,07 |
| TOTAL Tesorería | | | 16.646.474,03 | 17,21 |
| TOTAL PATRIMONIO NETO | | | 96.735.899,30 | 100,00 |

Sociedad gestora de carteras constituida en forma de sociedad por acciones simplificada (SAS) con un capital de 7.500.000 EUR

Autorizada por la Autorité des Marchés Financiers con el n.º GP 99011 - Inscrita en el Registro Mercantil de París con el n.º 340 902 857

12, boulevard de la Madeleine - 75440 Paris Cedex 09 Francia

Tel.: 33 (0)1 44 51 85 00 - www.am.oddo-bhf.com

ODDO BHF SUSTAINABLE EUROPEAN CONVERTIBLES

Reglamento sobre las operaciones de financiación de valores

31/12/2021

EUR

Activos comprometidos en cada tipo de operación de financiación de valores y de permuta de rentabilidad total, expresados en términos absolutos y en porcentaje sobre el patrimonio neto del Fondo

| | Préstamos de valores | Empréstito de valores | Operaciones con pacto de recompra | Operaciones con pacto de recompra inversa | Permuta de rentabilidad total |
|-----------------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------|
| Importe | | | | | |
| % del patrimonio neto total | | | | | |

Importe de los valores y las materias primas en préstamo, expresado en porcentaje sobre el total de activos

| | Préstamos de valores | Empréstito de valores | Operaciones con pacto de recompra | Operaciones con pacto de recompra inversa | Permuta de rentabilidad total |
|---|----------------------|-----------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------|
| Importe de los activos en préstamo | | | | | |
| % del total de activos susceptibles de préstamo | | | | | |

Los diez principales emisores de las garantías recibidas (con exclusión del efectivo) en todas las operaciones de financiación de valores (volumen de garantías en las transacciones en curso)

| | |
|--------------------------------|--|
| 1. Nombre | |
| Volumen de garantías recibidas | |
| 2. Nombre | |
| Volumen de garantías recibidas | |
| 3. Nombre | |
| Volumen de garantías recibidas | |
| 4. Nombre | |
| Volumen de garantías recibidas | |
| 5. Nombre | |
| Volumen de garantías recibidas | |
| 6. Nombre | |
| Volumen de garantías recibidas | |
| 7. Nombre | |
| Volumen de garantías recibidas | |
| 8. Nombre | |
| Volumen de garantías recibidas | |
| 9. Nombre | |
| Volumen de garantías recibidas | |
| 10. Nombre | |
| Volumen de garantías recibidas | |

Las diez principales contrapartes en términos absolutos de los activos y pasivos sin compensación

| | Préstamos de valores | Empréstito de valores | Operaciones con pacto de recompra | Operaciones con pacto de recompra inversa | Permuta de rentabilidad total |
|------------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------|
| 1. Nombre | | | | | |
| Importe | | | | | |
| Domicilio | | | | | |
| 2. Nombre | | | | | |
| Importe | | | | | |
| Domicilio | | | | | |
| 3. Nombre | | | | | |
| Importe | | | | | |
| Domicilio | | | | | |
| 4. Nombre | | | | | |
| Importe | | | | | |
| Domicilio | | | | | |
| 5. Nombre | | | | | |
| Importe | | | | | |
| Domicilio | | | | | |
| 6. Nombre | | | | | |
| Importe | | | | | |
| Domicilio | | | | | |
| 7. Nombre | | | | | |
| Importe | | | | | |
| Domicilio | | | | | |
| 8. Nombre | | | | | |
| Importe | | | | | |
| Domicilio | | | | | |
| 9. Nombre | | | | | |
| Importe | | | | | |
| Domicilio | | | | | |
| 10. Nombre | | | | | |
| Importe | | | | | |
| Domicilio | | | | | |

Tipo y calidad de la garantía

| | Préstamos de valores | Empréstito de valores | Operaciones con pacto de recompra | Operaciones con pacto de recompra inversa | Permuta de rentabilidad total |
|---------------------------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------|
| Tipo y calidad de la garantía | | | | | |
| Efectivo | | | | | |
| Instrumentos de deuda | | | | | |
| Calificación de calidad elevada | | | | | |
| Calificación de calidad media | | | | | |
| Calificación de calidad reducida | | | | | |
| Acciones | | | | | |
| Calificación de calidad elevada | | | | | |
| Calificación de calidad media | | | | | |
| Calificación de calidad reducida | | | | | |
| Participaciones del Fondo | | | | | |
| Calificación de calidad elevada | | | | | |
| Calificación de calidad media | | | | | |
| Calificación de calidad reducida | | | | | |
| Moneda de la garantía | | | | | |
| País del emisor de la garantía | | | | | |

Perfil de vencimiento de la garantía, desglosado con arreglo a los periodos de vencimiento que figuran a continuación

| | Préstamos de valores | Empréstito de valores | Operaciones con pacto de recompra | Operaciones con pacto de recompra inversa | Permuta de rentabilidad total |
|----------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------|
| menos de 1 día | | | | | |
| de 1 día a 1 semana | | | | | |
| de 1 semana a 1 mes | | | | | |
| de 1 a 3 meses | | | | | |
| de 3 meses a 1 año | | | | | |
| más de 1 año | | | | | |
| operaciones abiertas | | | | | |

Perfil de vencimiento de las operaciones de financiación de valores y de permutas de rentabilidad total, desglosado con arreglo a los periodos de vencimiento que figuran a continuación

| | Préstamos de valores | Empréstito de valores | Operaciones con pacto de recompra | Operaciones con pacto de recompra inversa | Permuta de rentabilidad total |
|----------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------|
| menos de 1 día | | | | | |
| de 1 día a 1 semana | | | | | |
| de 1 semana a 1 mes | | | | | |
| de 1 a 3 meses | | | | | |
| de 3 meses a 1 año | | | | | |
| más de 1 año | | | | | |
| operaciones abiertas | | | | | |

Liquidación y compensación de los contratos

| | Préstamos de valores | Empréstito de valores | Operaciones con pacto de recompra | Operaciones con pacto de recompra inversa | Permuta de rentabilidad total |
|----------------------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------|
| Entidad de contrapartida central | | | | | |
| Bilateral | | | | | |
| Tripartita | | | | | |

Datos sobre reutilización de las garantías

| | Efectivo | Títulos |
|---|----------|---------|
| Importe máximo (%) | | |
| Importe utilizado (%) | | |
| Rendimiento para el OIC de la reinversión de la garantía en efectivo de las operaciones de financiación de valores y las permutas de rentabilidad total | | |

Datos sobre la custodia de las garantías recibidas por el OIC

1. Nombre

Importe custodiado

| |
|--|
| |
| |

Datos sobre la custodia de las garantías concedidas por el OIC

| | |
|--|--|
| Importe total de la garantía atribuida | |
| En % del total de garantías atribuidas | |
| Cuentas separadas | |
| Cuentas conjuntas | |
| Otras cuentas | |

Datos desglosados sobre los ingresos

| | Préstamos de valores | Empréstito de valores | Operaciones con pacto de recompra | Operaciones con pacto de recompra inversa | Permuta de rentabilidad total |
|---|----------------------|-----------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------|
| OIC | | | | | |
| Importe | | | | | |
| en % de los ingresos | | | | | |
| Gestor | | | | | |
| Importe | | | | | |
| en % de los ingresos | | | | | |
| Terceros (por ejemplo, agente prestamista) | | | | | |
| Importe | | | | | |
| en % de los ingresos | | | | | |

Datos desglosados sobre los costes

| | Préstamos de valores | Empréstito de valores | Operaciones con pacto de recompra | Operaciones con pacto de recompra inversa | Permuta de rentabilidad total |
|---|----------------------|-----------------------|-----------------------------------|---|-------------------------------|
| OIC | | | | | |
| Importe | | | | -20,33 | |
| Gestor | | | | | |
| Importe | | | | | |
| Terceros (por ejemplo, agente prestamista) | | | | | |
| Importe | | | | | |