



# Dati semestrali al 29 settembre 2017

## Oddo Haut Rendement 2021

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

Società di gestione di portafogli costituita sotto forma di société par actions simplifiée (società per azioni semplificata) con capitale di 7.500.000 €

Autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers con il numero GP 99011 - RCS 340 902 857 Parigi  
12 boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Francia

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

## STATO PATRIMONIALE

Elementi dello stato patrimoniale	Importo alla data di chiusura periodica*
a) Le attività finanziarie di cui al 1° capoverso della lettera I dell'articolo L. 214-24-55 del Code monétaire et financier	794.679.120,76
b) Disponibilità presso banche	46.056.651,80
c) Altre attività detenute dall'OICVM	160.666.206,21
d) Totale delle attività detenute dall'OICVM	1.001.401.978,77
e) Passivo	-181.706.824,76
f) Valore patrimoniale netto	819.695.154,01

\* 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
OddoHR21 CR C	C1	385.446.271,36	3.439.686,1580	112,05
OddoHR21 CI C	C2	217.494.717,63	190.685,4820	1.140,59
OddoHR21 GC C	C3	63.825.676,39	560.052,9440	113,96
OddoHR21 CR C	C4	3.128.683,08	33.804,3340	92,55
OddoHR21 CI H C	C5	466.446,66	492,2660	947,55
OddoHR21 DR Di	D1	64.382.128,93	623.113,3940	103,32
OddoHR21 DI Di	D2	84.951.229,96	84.568,0620	1.004,53

Società di gestione di portafogli costituita sotto forma di société par actions simplifiée (società per azioni semplificata) con capitale di 7.500.000 €

Autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers con il numero GP 99011 - RCS 340 902 857 Parigi  
 12 boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Francia

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

**PROSPETTO DI COMPOSIZIONE DEL PORTAFOGLIO TITOLI**

Elementi del portafoglio titoli:	Percentuale	
	Patrimonio netto	Patrimonio totale
a) le attività finanziarie idonee e gli strumenti del mercato monetario ammessi alla negoziazione in un mercato regolamentato ai sensi dell'articolo L. 422-1	94,62	77,45
b) Le attività finanziarie idonee e gli 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	0
c) Le attività finanziarie idonee e gli 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	2,33	1,91
d) Le attività finanziarie di nuova emissione di cui al 4° capoverso della lettera I dell'articolo R. 214-11 del Code monétaire et financier;	0	0
e) Le altre attività: Altre attività di cui alla lettera II dell'articolo R. 214-11 del Code monétaire et financier	0	0

**RIPARTIZIONE DEL PATRIMONIO PER VALUTA**

Titoli	Valuta	Importo (EUR)	Percentuale	
			Patrimonio netto	Patrimonio totale
Rexel 3.25 150622	EUR	16.592.542,15	1,99	1,65
MatteTel 3.87 010522	EUR	15.610.895,56	1,9	1,56
UnitedGr 4.37 010722	EUR	15.495.162,50	1,89	1,55
AlliAutF 6.25 011221	EUR	15.456.266,10	1,89	1,54
EuropcGr 5.75 150622	EUR	15.267.587,40	1,86	1,52
Altice 7.25 150522	EUR	15.219.938,67	1,86	1,52
EircoFin 4.5 310522	EUR	14.564.589,01	1,78	1,45
SaliImpr 3.75 240621	EUR	14.229.783,65	1,74	1,42
ConGIPOw 5.12 150621	EUR	14.075.541,25	1,72	1,41
SynlBond 6.25 010722	EUR	14.041.458,89	1,71	1,4
PaprecHg 5.25 010422	EUR	13.615.051,67	1,66	1,36
IHOVerwa VAR 150921	EUR	13.487.521,67	1,65	1,35
SFRGr 5.37 150522	EUR	13.218.644,67	1,61	1,32
CirsaLux 5.75 150521	EUR	13.137.590,33	1,6	1,31
SapPapHg 3.37 010422	EUR	12.882.669,13	1,57	1,29
TitGIFin 3.5 170621	EUR	12.589.404,22	1,54	1,26
XPOLogis 5.75 150621	EUR	12.354.890,00	1,51	1,23
VWR 4.62 150422	EUR	12.111.398,00	1,48	1,21
Novafive 4.5 300621	EUR	11.973.520,50	1,46	1,2
OffiMacc 5.75 010621	EUR	11.438.839,83	1,4	1,14
WinAqFin 4 150720	EUR	11.094.855,67	1,35	1,11
EDreaOdi 8.5 010821	EUR	11.005.688,89	1,34	1,1
Banijay 4 010722	EUR	11.003.401,93	1,34	1,1
Snaitech 6.37 071121	EUR	10.771.332,39	1,31	1,08
3ABOptiD 5.62 150419	EUR	10.648.494,00	1,3	1,06
DarGIFin 4.75 300522	EUR	10.631.991,67	1,3	1,06
ThomCook 6.25 150622	EUR	10.630.536,30	1,3	1,06
ThyssenK 1.37 030322	EUR	10.207.474,54	1,25	1,02
InovyFin 6.25 150521	EUR	10.176.656,00	1,24	1,02
CMC 7.5 010821	EUR	10.019.159,67	1,22	1
CNHInFi 1.37 230522	EUR	9.495.743,88	1,16	0,95
IntCapLu 6 150521	EUR	9.245.368,00	1,13	0,92
FTEVerwa 9 150720	EUR	9.060.044,70	1,11	0,9
SaipFinI 2.75 050422	EUR	8.671.128,03	1,06	0,87
Progroup 5.12 010522	EUR	8.568.311,11	1,05	0,86
Constell 4.62 150521	EUR	8.485.927,17	1,04	0,85
CodeFin2 6.75 011121	EUR	8.483.000,25	1,03	0,85
HomeVi 6.87 150821	EUR	8.463.692,53	1,03	0,85
SarenFin 5.12 050222	EUR	8.429.888,25	1,03	0,84
FedMogHg 4.87 150422	EUR	8.423.605,13	1,03	0,84
MerliEnt 2.75 150322	EUR	8.408.040,00	1,03	0,84
CasinoGu VAR 260521	EUR	8.361.110,68	1,02	0,83

Società di gestione di portafogli costituita sotto forma di société par actions simplifiée (società per azioni semplificata) con capitale di 7.500.000 €

Autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers con il numero GP 99011 - RCS 340 902 857 Parigi

12 boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Francia

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

Titoli	Valuta	Importo (EUR)	Percentuale	
			Patrimonio netto	Patrimonio totale
BMBGBdFi 3 150621	EUR	8.321.331,15	1,02	0,83
SwissFin 6.75 151221	EUR	8.276.920,20	1,01	0,83
AldesFin 7.25 010421	EUR	7.986.262,50	0,97	0,8
GameGr 6 150821	EUR	7.356.556,66	0,9	0,73
CorPeHgs VAR 150521	EUR	6.886.006,67	0,84	0,69
ThoCoFin 6.75 150621	EUR	6.841.088,00	0,83	0,68
Autodis 4.37 010522	EUR	6.840.029,44	0,83	0,68
BuTelEAD 6.62 151118	EUR	6.698.872,92	0,82	0,67
InterxHg 6 150720	EUR	6.519.769,17	0,8	0,65
FiaChFin 4.75 220321	EUR	6.401.397,59	0,78	0,64
Loxam 3.5 150422	EUR	6.002.744,53	0,73	0,6
TraveFin 8 150522	EUR	5.814.648,89	0,71	0,58
ArcelorM 3.12 140122	EUR	5.545.457,53	0,68	0,55
GrAntoDu 5.12 300622	EUR	5.460.363,88	0,67	0,55
AlticFin 6.5 150122	EUR	5.307.416,66	0,65	0,53
PicaBond 7.75 010220	EUR	5.279.636,11	0,64	0,53
Loxam 4.87 230721	EUR	5.126.595,64	0,63	0,51
Autodis FRN 010522	EUR	5.092.431,25	0,62	0,51
IntrCapL 6.75 150921	EUR	5.086.612,50	0,62	0,51
TUI 2.12 261021	EUR	4.888.838,41	0,6	0,49
CMF 9 150622	EUR	4.515.525,00	0,55	0,45
Elis 3 300422	EUR	4.495.780,80	0,55	0,45
CasinoGu 1.86 130622	EUR	4.493.908,05	0,55	0,45
NyrstaNI 8.5 150919	EUR	4.458.360,00	0,54	0,45
SelectGr 6.5 150620	EUR	4.452.994,00	0,54	0,44
VolvoCar 3.25 180521	EUR	4.375.510,00	0,53	0,44
AngAmCap 3.5 280322	EUR	4.352.784,16	0,53	0,43
OTE 3 090720	EUR	4.234.306,30	0,52	0,42
GualaClo FRN 151121	EUR	4.131.985,22	0,5	0,41
InteFinc 7.37 151020	EUR	4.023.700,00	0,49	0,4
Saipem 3 080321	EUR	3.903.845,65	0,48	0,39
GlwREInv 2.87 200622	EUR	3.643.121,67	0,44	0,36
CrysAlmo 10 011121	EUR	2.837.583,57	0,35	0,28
ECFin 5.12 150721	EUR	1.863.259,50	0,23	0,19
<b>TOTALE</b>	<b>EUR</b>	<b>669.164.389,61</b>	<b>81,64</b>	<b>66,82</b>
JagLAuRo 5 150222	GBP	13.889.906,41	1,7	1,39
BMEurVaR 4.12 010222	GBP	10.845.381,36	1,32	1,08
WillHill 4.25 050620	GBP	10.798.779,03	1,32	1,08
Tesco 6.12 240222	GBP	9.990.297,96	1,22	1
MoyParBo 6.25 290521	GBP	9.722.953,86	1,19	0,97
StoPuFin 4.87 150322	GBP	8.604.432,18	1,05	0,86
BoparFin 5.5 150721	GBP	8.062.735,70	0,98	0,81
WagamFin 4.12 010722	GBP	6.934.108,42	0,85	0,69
ViMeSFin 5.5 150121	GBP	6.413.832,28	0,78	0,64
PizzexF2 6.62 010821	GBP	5.449.354,74	0,66	0,54

Società di gestione di portafogli costituita sotto forma di société par actions simplifiée (società per azioni semplificata) con capitale di 7.500.000 €

Autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers con il numero GP 99011 - RCS 340 902 857 Parigi

12 boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Francia

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

Titoli	Valuta	Importo (EUR)	Percentuale	
			Patrimonio netto	Patrimonio totale
PerGrFin 8.5 151120	GBP	4.209.139,49	0,51	0,42
JagLRoAu 2.75 240121	GBP	3.477.452,85	0,42	0,35
<b>TOTALE</b>	<b>GBP</b>	<b>98.398.374,28</b>	<b>12</b>	<b>9,83</b>
IntlGTec 6.25 150222	USD	11.947.171,94	1,45	1,19
FiatChr 4.5 150420	USD	7.176.721,37	0,88	0,72
Constell 7.87 010421	USD	4.933.519,07	0,6	0,49
AngAmCap 3.75 100422	USD	1.763.933,07	0,22	0,18
WinAqFin 4.75 150720	USD	1.295.011,42	0,16	0,13
<b>TOTALE</b>	<b>USD</b>	<b>27.116.356,87</b>	<b>3,31</b>	<b>2,71</b>
<b>TOTALE</b>		<b>794.679.120,76</b>	<b>96,95</b>	<b>79,36</b>

Società di gestione di portafogli costituita sotto forma di société par actions simplifiée (società per azioni semplificata) con capitale di 7.500.000 €

Autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers con il numero GP 99011 - RCS 340 902 857 Parigi

12 boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Francia

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

## RIPARTIZIONE DEL PATRIMONIO PER SETTORE ECONOMICO

Settore di attività	Percentuale	
	Patrimonio netto	Patrimonio totale
Altri servizi finanziari	29,72	24,34
Casinò e case da gioco	3,81	3,12
Special Purpose Vehicle	3,62	2,96
Acciaio	3,56	2,91
Società produttrici di automobili	3,53	2,89
Software e servizi Internet	3,23	2,65
Altri settori	49,48	40,49
<b>TOTALE</b>	<b>96,95</b>	<b>79,36</b>

## RIPARTIZIONE DEL PATRIMONIO PER PAESE DI RESIDENZA DELL'EMITTENTE

Paese	Percentuale	
	Patrimonio netto	Patrimonio totale
REGNO UNITO	24,36	19,96
LUXEMBOURG	19,44	15,91
FRANCIA	17,23	14,1
Altri paesi	35,92	29,39
<b>TOTALE</b>	<b>96,95</b>	<b>79,36</b>

## RIPARTIZIONE DELLE ALTRE ATTIVITÀ PER TIPOLOGIA

Società di gestione di portafogli costituita sotto forma di société par actions simplifiée (società per azioni semplificata) con capitale di 7.500.000 €

Autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers con il numero GP 99011 - RCS 340 902 857 Parigi

12 boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Francia

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

**MOVIMENTI DEL PORTAFOGLIO TITOLI NEL CORSO DEL PERIODO**

Elementi del portafoglio titoli	Movimenti (importo)	
	Acquisizioni	Cessioni
a) Le attività finanziarie idonee e gli strumenti del mercato monetario ammessi alla negoziazione in un mercato regolamentato ai sensi dell'articolo L. 422-1 del Code monétaire et financier	145.989.502,96	81.505.731,19
b) Le attività finanziarie idonee e gli 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) Le attività finanziarie idonee e gli strumenti del mercato monetario ammessi alla quotazione ufficiale di una borsa valori di un paese terzo o negoziati su un altro mercato di uno Stato terzo, regolamentato, regolarmente funzionante, riconosciuto e aperto al pubblico, purché tale borsa valori o tale mercato non figurino su una lista predisposta dall'Autorité des marchés financiers e a condizione che la scelta della borsa o del mercato sia prevista dalla legge, dal regolamento o dallo statuto dell'organismo di investimento collettivo in valori mobiliari	5.014.195,36	0,00
d) Le 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) Le altre attività: Altre attività di cui alla lettera II dell'articolo R. 214-11 del Code monétaire et financier	0,00	0,00

Movimenti verificatisi nel corso del periodo	Movimenti (importo)
Acquisizioni	151.003.698,32
Cessioni	81.505.731,19

Società di gestione di portafogli costituita sotto forma di société par actions simplifiée (società per azioni semplificata) con capitale di 7.500.000 €

Autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers con il numero GP 99011 - RCS 340 902 857 Parigi  
 12 boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Francia

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



**DISTRIBUZIONE NEL CORSO DEL PERIODO**

	<b>Classe</b>	<b>Importo netto unitario</b>	<b>Credito d'imposta</b>	<b>Importo lordo unitario</b>
	<b>€</b>	<b>€</b>	<b>€</b>	<b>€</b>
	D1 Classe DR-EUR D1 Classe DR-EUR D2 Classe DI-EUR D2 Classe DI-EUR			
<b>Dividendi da distribuire</b>				
07/07/2017	D1 Classe DR-EUR	3,13		3,13
	D2 Classe DI-EUR	30,31		30,31
<b>Dividendi distribuiti</b>				

<b>Fondo</b>	ODDO HAUT RENDEMENT 2021 (8287)
<b>Data</b>	29/09/2017
<b>Patrimonio netto</b>	819.695.154,01 EUR

categoria	codice titolo	denominazione	valuta	Quantità	Quotazione	valore di mercato	% patrimonio netto
<b>Disponibilità</b>				(75.618.006,59)	30,96	38.617.302,06	<b>4,71%</b>
<b>Obbligazioni negoziate su un mercato regolamentato o assimilato</b>				<b>656.579.500,00</b>	<b>10.109,55</b>	<b>695.212.696,98</b>	<b>84,81%</b>
	XS1107268135	Nystrar Netherlands (Hgs) BV 8.5% Reg S Sen 14/15.09.19	EUR	4.000.000,00	111,03	4.458.360,00	0,54%
	XS1028948120	Pizzaexpress Financing 2 Plc 6.625% Reg S Sen 14/01.08.21	GBP	5.000.000,00	94,90	5.449.354,74	0,66%
	XS1400707771	Corral Petroleum Hgs AB VAR TOG PIK Reg S Sen 16/15.05.21	EUR	6.000.000,00	111,76	6.886.006,67	0,84%
	XS1504103984	TUI AG 2.125% Reg S Sen 16/26.10.21	EUR	4.600.000,00	312,86	4.888.838,41	0,60%
	XS1517169899	Autodis SA 4.375% Reg S Sen 16/01.05.22	EUR	6.500.000,00	103,38	6.840.029,44	0,83%
	XS1028950704	EC Finance Plc 5.125% Reg S 14/15.07.21	EUR	1.800.000,00	102,40	1.863.259,50	0,23%
	XS1028956222	SFR Group SA 5.375% Reg S 14/15.05.22	EUR	12.580.000,00	104,36	13.218.644,67	1,61%
	XS1003905152	Altice Financing SA 6.5% Reg S 13/15.01.22	EUR	5.000.000,00	209,48	5.307.416,66	0,65%
	DE000A161GC3	Progroup AG 5.125% Reg S Sen 15/01.05.22	EUR	8.000.000,00	104,94	8.568.311,11	1,05%
	XS1491985476	EDreams ODIGEO SA 8.5% Reg S Sen 16/01.08.21	EUR	10.000.000,00	108,59	11.005.688,89	1,34%
	XS1246049073	Grupo Antolin Dutch BV 5.125% Sen 15/30.06.22	EUR	5.100.000,00	105,74	5.460.363,88	0,67%
	XS1591779399	Loxam 3.5% Sen Reg S 17/15.04.22	EUR	5.683.000,00	629,21	6.002.744,53	0,73%
	XS1517169972	Autodis SA FRN Reg S Sen 16/01.05.22	EUR	5.000.000,00	101,08	5.092.431,25	0,62%
	XS1298004612	Interoute Finco Plc 7.375% Reg S Sen 15/15.10.20	EUR	3.750.000,00	103,86	4.023.700,00	0,49%
	XS1064899120	Intralot Cap Luxembourg SA 6% Reg S Sen 14/15.05.21	EUR	8.800.000,00	102,76	9.245.368,00	1,13%
	XS1435297202	Salini Impregilo SpA 3.75% Reg S Sen 16/24.06.21	EUR	12.834.000,00	329,51	14.229.783,65	1,74%
	BE6275588760	Sarens Finance Co NV 5.125% 15/05.02.22	EUR	8.100.000,00	103,25	8.429.888,25	1,03%
	XS1409634612	Volvo Car AB 3.25% Reg S Sen 16/18.05.21	EUR	4.000.000,00	108,17	4.375.510,00	0,53%
	XS1028956909	3AB Optique Dev SAS 5.625% Reg S Sen 14/15.04.19	EUR	10.350.000,00	100,26	10.648.494,00	1,30%
	XS1577957837	Gobalworth Real Estate Invs Ltd 2.875% Sen Reg S 17/20.06.22	EUR	3.542.000,00	102,02	3.643.121,67	0,44%
	XS1405766202	Crystal Almond Sàrl 10% Reg S Sen 16/01.11.21	EUR	2.462.000,00	111,03	2.837.583,57	0,35%
	XS1458462428	Gamenet Group SpA 6% Reg S Sen 16/15.08.21	EUR	7.000.000,00	312,83	7.356.556,66	0,90%
	XS1207387801	VWR Funding Inc 4.625% Reg S Sub Sen 15/15.04.22	EUR	11.400.000,00	104,08	12.111.398,00	1,48%
	DE000A2BPE22	ThyssenKrupp AG 1.375% Reg S Sen 17/03.03.22	EUR	9.998.000,00	101,29	10.207.474,54	1,25%
	USG0446NAK03	Anglo American Capital Plc 3.75% Sen Reg S 17/10.04.22	USD	2.000.000,00	102,46	1.763.933,07	0,22%
	XS1555825378	Jaguar Land Rover Automoti Plc 2.75% Reg S Sen 17/24.01.21	GBP	3.000.000,00	101,55	3.477.452,85	0,42%
	XS1117298676	Sappi Papier Holdings GmbH 3.375% Reg S Sen 15/01.04.22	EUR	12.550.000,00	102,63	12.882.669,13	1,57%
	XS1490152565	IHO Verwaltungs GmbH VAR TOG PIK Reg S 16/15.09.21	EUR	13.000.000,00	102,70	13.487.521,67	1,65%
	XS1241053666	Europcar Group SA 5.75% Reg S Sen 15/15.06.22	EUR	14.220.000,00	211,28	15.267.587,40	1,86%
	XS1207101418	Paprec Holding SA 5.25% Reg S 15/01.04.22	EUR	13.000.000,00	104,70	13.615.051,67	1,66%
	US210383AE55	Constellium NV 7.875% Ser 144A 16/01.04.21	USD	5.500.000,00	106,00	4.933.519,07	0,60%
	US31562QAC15	Fiat Chrysler Automobiles NV 4.5% Sen 15/15.04.20	USD	8.000.000,00	103,95	7.176.721,37	0,88%
	XS0946728564	Interxion Holding NV 6% Reg S 13/15.07.20	EUR	6.249.000,00	103,03	6.519.769,17	0,80%
	XS1577963306	Travelex Financing Plc 8% Reg S Sen 17/15.05.22	EUR	5.500.000,00	204,86	5.814.648,89	0,71%
	XS1531306717	Thomas Cook Group Plc 6.25% Reg S Sen 16/15.06.22	EUR	9.615.000,00	108,69	10.630.536,30	1,30%
	USG4863AAB47	Intl Game Technology Plc 6.25% Reg S Sen 15/15.02.22	USD	12.800.000,00	109,51	11.947.171,94	1,46%
	XS1172436211	Thomas Cook Fin Plc 6.75% Reg S Sen 15/15.06.21	EUR	6.400.000,00	104,87	6.841.088,00	0,83%
	XS1432395785	Eircom Finance DAC 4.5% Reg S Sen 16/31.05.22	EUR	13.800.000,00	208,01	14.564.589,01	1,78%
	XS1516322465	Guala Closures SpA FRN Reg S Sen 16/15.11.21	EUR	4.082.000,00	100,58	4.131.985,22	0,50%
	XS1028950886	Novafives 4.5% Reg S 14/30.06.21	EUR	11.650.000,00	101,80	11.973.520,50	1,46%
	XS1082472587	Boparan Finance Plc 5.5% Reg S Ser 144A 14/15.07.21	GBP	7.500.000,00	94,00	8.062.735,70	0,98%
	XS1644604958	Swissport Financing Sàrl 6.75% Sen 144A 17/15.12.21	EUR	7.620.000,00	106,60	8.276.920,20	1,01%
	XS1513765922	Codere Finance 2 (Lux) SA 6.75% Reg S Sen 16/01.11.21	EUR	7.900.000,00	209,02	8.483.000,25	1,03%
	XS1432585997	BMBG Bond Finance SCA 3% Reg S Sen 16/15.06.21	EUR	8.000.000,00	309,35	8.321.331,15	1,02%
	XS1219465728	Matterhorn Telecom SA 3.875% Reg S Sen 15/01.05.22	EUR	14.900.000,00	103,14	15.610.895,56	1,90%
	XS1117298833	Picard BondCo SA 7.75% Reg S Sen 15/01.02.20	EUR	5.000.000,00	104,26	5.279.636,11	0,64%
	XS1082636876	Wind Acquisition Finance SA 4% Reg S 14/15.07.20	EUR	10.900.000,00	100,92	11.094.855,67	1,35%
	XS1078234330	Selecta Group BV 6.5% Reg S 14/15.06.20	EUR	4.300.000,00	101,61	4.452.994,00	0,54%
	XS1204272709	Merlin Entertainments Plc 2.75% Reg S Sen 15/15.03.22	EUR	8.000.000,00	104,96	8.408.040,00	1,03%
	XS1513691979	Snaitch SpA 6.375% Reg S Sen 16/07.11.21	EUR	9.828.000,00	107,01	10.771.332,39	1,31%
	XS1093814116	HomeVi SAS 6.875% Reg S Sen 14/15.08.21	EUR	8.120.000,00	103,32	8.463.692,53	1,03%
	XS1089828450	Loxam 4.875% Reg S 14/23.07.21	EUR	4.927.500,00	102,58	5.126.595,64	0,63%
	XS1025866119	Jaguar Land Automoti Rover Plc 5% Reg S Sen 14/15.02.22	GBP	11.100.000,00	109,60	13.889.906,41	1,69%
	XS1405774727	Intralot Capital Luxembourg SA 6.75% Reg S Sen 16/15.09.21	EUR	4.740.000,00	106,98	5.086.612,50	0,62%
	USL97437AL89	Wind Acquisition Finance SA 4.75% Reg S Sen 14/15.07.20	USD	1.500.000,00	101,04	1.295.011,42	0,16%
	XS1647814968	United Group BV 4.375% Sen Reg S 17/01.07.22	EUR	15.000.000,00	102,50	15.495.162,50	1,89%
	XS1575503146	Stonegate Pub Co Financing Plc 4.875% Sen Reg S 17/15.03.22	GBP	7.494.000,00	100,93	8.604.432,18	1,05%
	XS1088811432	Coop Mur Cem CMC Rav Soc Coop 7.5% Reg S Sen 14/01.08.21	EUR	9.550.000,00	103,62	10.019.159,67	1,22%
	XS1074596344	Officine Maccaferri SpA 5.75% Reg S Sen 14/01.06.21	EUR	11.100.000,00	101,10	11.438.839,83	1,40%
	XS1225112272	Elis SA 3% Reg S Sen 15/30.04.22	EUR	4.320.000,00	102,79	4.495.780,80	0,55%
	XS1072495242	Moy Park Bondco Plc 6.25% Reg S 14/29.05.21	GBP	8.160.000,00	102,84	9.722.953,86	1,19%
	XS0941604307	William Hill Plc 4.25% Reg S Sen 13/05.06.20	GBP	9.000.000,00	104,34	10.798.779,03	1,32%
	XS1587905727	Federal Mogul Hgs LLC 4.875% Sen Reg S 17/15.04.22	EUR	8.100.000,00	101,52	8.423.605,13	1,03%
	XS1642700766	Banijay Group SAS 4% Sen Reg S 17/01.07.22	EUR	10.439.000,00	104,44	11.003.401,93	1,34%
	XS1117292984	Synlab Bondco Plc 6.25% Reg S Sen 15/01.07.22	EUR	13.000.000,00	106,41	14.041.458,89	1,71%
	XS1433185755	ContourGlobal Power Hgs SA 5.125% Reg S Sen 16/15.06.21	EUR	13.250.000,00	104,69	14.075.541,25	1,72%

Società di gestione di portafogli costituita sotto forma di société par actions simplifiée (società per azioni semplificata) con capitale di 7.500.000 €

Autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers con il numero GP 99011 - RCS 340 902 857 Parigi

12 boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Francia

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

	XS1238996018	Rexel SA 3.25% Reg S Sen 15/15.06.22	EUR	15.949.000,00	103,06	16.592.542,15	2,02%
	XS1061642317	Altice NV 7.25% Reg S 14/15.05.22	EUR	14.200.000,00	106,22	15.219.938,67	1,86%
	XS1137505290	Alliance Automotive Fin Plc 6.25% 14/01.12.21	EUR	14.580.000,00	103,89	15.456.266,10	1,89%
	XS0952827094	FTE Verwaltungs GmbH 9% Reg S 13/15.07.20	EUR	8.610.000,00	103,28	9.060.044,70	1,11%
	XS1640922917	Wagamama Finance Plc 4.125% Sen Reg S 17/01.07.22	GBP	6.077.000,00	99,60	6.934.108,42	0,85%
	XS1642816554	CMF SpA 9% Sen Reg S 17/15.06.22	EUR	4.500.000,00	98,17	4.515.525,00	0,55%
	XS0658363865	Virgin Media Secured Fin Plc 5.5% Sen 11/15.01.21	GBP	5.000.000,00	111,84	6.413.832,28	0,78%
	XS1405784288	Inovyn Finance Plc 6.25% Reg S Sen 16/15.05.21	EUR	12.000.000,00	103,61	10.176.656,00	1,24%
	XS1429814830	Titan Global Finance Plc 3.5% Reg S Sen 16/17.06.21	EUR	11.650.000,00	107,03	12.589.404,22	1,54%
	XS1400351653	Cirsa Funding Luxembourg SA 5.75% Reg S Sen 16/15.05.21	EUR	12.200.000,00	105,48	13.137.590,33	1,60%
	XS1117295060	XPO Logistics Inc 5.75% Reg S Sen 15/15.06.21	EUR	11.750.000,00	103,42	12.354.890,00	1,51%
	XS1240984754	Darling Global Fin BV 4.75% Reg S Sen 15/30.05.22	EUR	10.000.000,00	104,70	10.631.991,67	1,30%
	XS1318524367	Perform Group Financing Plc 8.5% Reg S Sen 15/15.11.20	GBP	3.450.000,00	104,25	4.209.139,49	0,51%
<b>AGGIUNGERE AL DIZIONARIO: Debiti derivanti da pronti contro termine</b>				<b>(13.631.683,00)</b>	<b>-</b>	<b>-13.606.110,75</b>	<b>-1,66%</b>
		XS1591779399 220918	EUR	(293.250,00)	-	-293.175,33	-0,04%
		XS1504103984 180818	EUR	(1.271.400,00)	-	-1.270.287,60	-0,15%
		XS1577963306 140618	EUR	(1.862.025,00)	-	-1.855.265,18	-0,23%
		XS1003905152 160818	EUR	(105.920,00)	-	-105.798,84	-0,01%
		XS1458462428 040918	EUR	(427.788,00)	-	-427.557,55	-0,05%
		XS1432585997 260518	EUR	(524.375,00)	-	-522.113,01	-0,06%
		XS1591779399 090618	EUR	(848.000,00)	-	-844.834,32	-0,10%
		XS1432585997 110518	EUR	(1.571.250,00)	-	-1.565.244,94	-0,19%
		XS1458462428 070818	EUR	(454.705,00)	-	-453.813,54	-0,06%
		XS1504103984 050718	EUR	(2.506.800,00)	-	-2.502.018,35	-0,31%
		XS1435297202 270918	EUR	(2.222.220,00)	-	-2.222.108,27	-0,27%
		XS1591779399 270918	EUR	(1.543.950,00)	-	-1.543.893,82	-0,19%
<b>Altri titoli di debito</b>				<b>90.576.000,00</b>	<b>1.481,54</b>	<b>99.466.423,78</b>	<b>12,13%</b>
	XS1557228357	B&M European Value Retail SA 4.125% EMTN Reg S 17/01.02.22	GBP	9.150.000,00	103,75	10.845.381,36	1,32%
	XS1048568452	Fiat Chrysler Fin Europe SA 4.75% EMTN Reg S Sen 14/22.03.21	EUR	5.600.000,00	111,77	6.401.397,59	0,78%
	XS1616917800	CNH Industrial Fin Europe SA 1.375% EMTN Sen 17/23.05.22	EUR	9.274.000,00	101,89	9.495.743,88	1,16%
	XS1028959754	Aldesa Financial Services S.A. 7.25% EMTN Sen 14/01.04.21	EUR	8.100.000,00	97,03	7.986.262,50	0,97%
	XS0764637194	Anglo American Capital Plc 3.5% EMTN 12/28.03.22	EUR	3.850.000,00	111,25	4.352.784,16	0,53%
	XS1167308128	ArcelorMittal SA 3.125% EMTN Sen 15/14.01.22	EUR	5.000.000,00	108,67	5.545.457,53	0,68%
	XS1064882316	Constellium NV 4.625% EMTN Reg S Sen 14/15.05.21	EUR	8.200.000,00	101,71	8.485.927,17	1,04%
	XS1487498922	Saipem SpA 3% EMTN Reg S Sen 16/08.03.21	EUR	3.669.000,00	104,68	3.903.845,65	0,48%
	XS0994993037	Bulgarian Tel Co EAD 6.625% EMTN Reg S 13/15.11.18	EUR	6.500.000,00	100,52	6.698.872,92	0,82%
	XS1086785182	OTE Plc 3% EMTN Sen 14/09.07.20	EUR	4.000.000,00	105,03	4.234.306,30	0,52%
	XS0414345974	Tesco Plc 6.125% EMTN Reg S Ser 68 09/24.02.22	GBP	7.500.000,00	113,67	9.990.297,96	1,22%
	FR0011052661	Casino Guichard Perrachon VAR EMTN Lk Rating Ch 11/26.05.21	EUR	7.000.000,00	117,32	8.361.110,68	1,02%
	FR0013260379	Casino Guichard Perrachon 1.865% EMTN Sen Reg S 17/13.06.22	EUR	4.400.000,00	101,56	4.493.908,05	0,55%
	XS1591523755	Saipem Finance Intl BV 2.75% EMTN Sen Reg S 17/05.04.22	EUR	8.333.000,00	102,69	8.671.128,03	1,06%
<b>Crediti rappresentativi dei titoli dati in prestito in pronti contro termine</b>				<b>7.496.724,40</b>	<b>-</b>	<b>4.841,94</b>	<b>0,00%</b>
		XS1591779399 070618	EUR	689.000,00	-	468,90	0,00%
		XS1435297202 140918	EUR	3.925.958,40	-	2.290,14	0,00%
		XS1432395785 040818	EUR	1.083.485,00	-	379,22	0,00%
		XS1513765922 250718	EUR	521.400,00	-	547,47	0,00%
		XS1241053666 310118	EUR	1.055.100,00	-	1.005,28	0,00%
		XS1591779399 170818	EUR	221.781,00	-	150,93	0,00%
<b>Patrimonio netto</b>						<b>819.695.154,01</b>	<b>100,00%</b>

Società di gestione di portafogli costituita sotto forma di société par actions simplifiée (società per azioni semplificata) con capitale di 7.500.000 €

Autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers con il numero GP 99011 - RCS 340 902 857 Parigi

12 boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Francia

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

## **ODDO HAUT RENDEMENT 2021**

### **Regolamento sulle operazioni di finanziamento tramite titoli**

**29/09/2017**

**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

	Titoli concessi in prestito	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
Importo			13.743.263,35		
% del patrimonio netto totale			1,68%		

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

	Titoli concessi in prestito	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
Importo delle attività in prestito	7.514.549,84				
% delle attività prestabili	0,95%				

### 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	

Società di gestione di portafogli costituita sotto forma di société par actions simplifiée (società per azioni semplificata) con capitale di 7.500.000 €

Autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers con il numero GP 99011 - RCS 340 902 857 Parigi

12 boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Francia

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

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

	Titoli concessi in prestito	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
1. Denominazione	ODDO BHF		ODDO BHF		
Importo	7.514.549,84		13.743.263,35		
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					

Società di gestione di portafogli costituita sotto forma di société par actions simplifiée (società per azioni semplificata) con capitale di 7.500.000 €

Autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers con il numero GP 99011 - RCS 340 902 857 Parigi

12 boulevard de la Madeleine – 75440 Paris Cedex 09 Francia

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

**Tipo e qualità delle garanzie reali (collaterale)**

	Titoli concessi in prestito	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
<b>Tipo e qualità della garanzia reale</b>					
<b>Liquidità</b>	-7.871.560,62				
<b>Strumenti di debito</b>					
Rating di buona qualità					
Rating di qualità media					
Rating di bassa qualità					
<b>Azioni</b>					
Rating di buona qualità					
Rating di qualità media					
Rating di bassa qualità					
<b>Quote di fondi</b>					
Rating di buona qualità					
Rating di qualità media					
Rating di bassa qualità					
<b>Valuta della garanzia</b>					
<b>Paese dell'emittente della garanzia reale</b>					

**Scadenza della garanzia reale, classificata nelle seguenti categorie**

	Titoli concessi in prestito	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

	Titoli concessi in prestito	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	7.514.549,84		13.743.263,35		

### Regolamento e compensazione dei contratti

	Titoli concessi in prestito	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

Importo custodito




### 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

	Titoli concessi in prestito	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
<b>OICR</b>					
Importo	51.500,42		141.098,69		
in % dei rendimenti	0,33%		0,90%		
<b>Gestore</b>					
Importo					
in % dei rendimenti					
<b>Terzi (es. agente mutuante, ecc.)</b>					
Importo					
in % dei rendimenti					

### Dati concernenti la scomposizione dei costi

	Titoli concessi in prestito	Titoli assunti in prestito	Pronti contro termine passivi	Pronti contro termine attivi	Total return swap
<b>OICR</b>					
Importo					
<b>Gestore</b>					
Importo					
<b>Terzi (es. agente mutuante, ecc.)</b>					
Importo					