



ODDO BHF
ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht

Basis-Fonds | Nachhaltig

31. März 2023

Vermögensübersicht zum 31.3.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	% Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	110.588.089,73	100,04
1. Anleihen	102.545.040,44	92,77
< 1 Jahr	40.896.996,78	37,00
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	32.093.133,46	29,03
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	11.453.905,88	10,36
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	8.980.451,02	8,12
>= 10 Jahre	9.120.553,30	8,25
2. Investmentanteile	3.716.500,00	3,36
EUR	3.716.500,00	3,36
3. Bankguthaben	3.585.042,46	3,24
4. Sonstige Vermögensgegenstände	741.506,83	0,67
II. Verbindlichkeiten	./45.639,89	./0,04
III. Fondsvermögen	110.542.449,84	100,00

Vermögensaufstellung zum 31.3.2023

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 31.3.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in	%-Anteil am Fonds- vermögen
Währung in 1.000		EUR	EUR	EUR	%	EUR	
Bestandspositionen						106.261.540,44	96,13
Börsengehandelte Wertpapiere						96.470.493,62	87,27
Verzinsliche Wertpapiere						96.470.493,62	87,27
3,6250 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred MTN 23(26)	XS2573331324	1.000	1.000	0	99,402	994.024,00	0,90
4,7500 % Allianz SE FLR-Med.Ter.Nts.v.13(23/ unb.)	DE000A1YCQ29	1.800	800	0	99,800	1.796.400,00	1,63
2,2410 % Allianz SE FLR-Sub.Anl.v.15(25/45)	DE000A14J9N8	1.000	0	0	94,124	941.240,00	0,85
3,6510 % AT & T Inc. EO-FLR Notes 18(23)	XS1907118464	1.000	0	0	100,206	1.002.060,00	0,91
1,3000 % AT & T Inc. EO-Notes 15(15/23)	XS1196373507	1.000	0	0	99,131	991.310,00	0,90
0,2500 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 22(25)	XS2456253082	1.273	0	0	93,879	1.195.077,12	1,08
3,9410 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 14(24/Und.)	XS1134541306	1.000	1.000	0	97,328	973.276,00	0,88
5,1250 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 13(23/43)	XS0878743623	800	0	0	99,967	799.736,00	0,72
2,5750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Med.-T.Nts 19(24/29)	XS1954087695	200	0	0	97,490	194.980,00	0,18
3,6930 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Med.-Term Nts 22(25)	XS2485259670	500	0	0	100,721	503.605,00	0,46
0,1250 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Preferred MTN 21(26/27)	XS2322289385	1.000	0	0	89,719	897.191,00	0,81
3,5400 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(24)	XS2476266205	500	0	0	100,676	503.380,00	0,46
0,1000 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(24/25)	XS2436160779	1.000	0	0	96,909	969.090,00	0,88
1,7760 % Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 17(17/27)	XS1602547264	1.000	0	0	93,160	931.595,00	0,84
3,8920 % Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 21(25/26)	XS2387929834	2.000	0	0	99,546	1.990.920,00	1,80
3,5000 % Bertelsmann SE & Co. KGaA MTN v.22(22/29)	XS2560753936	700	700	0	98,606	690.239,90	0,62
0,0000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 21(26)	XS2280845491	758	0	0	92,106	698.160,45	0,63
0,3750 % BNP Paribas Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.15(25)	FR0012716371	1.100	1.100	0	93,936	1.033.292,70	0,93
3,2740 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 18(23)	XS1823532996	1.000	0	0	100,023	1.000.230,00	0,90
0,5000 % BNZ International Funding Ltd. EO-Medium-Term Notes 17(23)	XS1717012014	1.000	0	0	99,675	996.750,00	0,90
4,6250 % BPCE S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 23(29/30)	FR001400G6Y4	500	500	0	101,401	507.003,00	0,46
0,6250 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25)	FR0013509726	1.000	0	0	93,893	938.930,00	0,85
4,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 23(29)	FR001400GGZ0	800	800	0	101,623	812.984,00	0,74
3,7500 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 23(23/31)	XS2582814039	435	435	0	98,038	426.463,56	0,39
2,2000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.22(24)	DE0001104909	2.000	2.000	0	99,080	1.981.600,00	1,79
0,2500 % Cie de Financement Foncier EO-Med.-T. Obl.Fonc. 18(23)	FR0013328218	1.000	0	0	99,951	999.510,00	0,90
4,2500 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Notes 14(25/45)	FR0011949403	700	0	0	97,402	681.810,50	0,62
5,1250 % Commerzbank AG Med.Term-FLN v.23(29/30)	DE000CZ43ZN8	500	500	0	98,622	493.111,50	0,45

Halbjahresbericht für Basis-Fonds I Nachhaltig

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 31.3.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in	%-Anteil am Fonds- vermögen
Währung in 1.000		EUR	EUR	EUR	%	EUR	
0,2500 % Commerzbank AG MTH S.P25 v.18(23)	DE000CZ40MW3	2.000	2.000	0	98,738	1.974.760,00	1,79
1,6250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-T. Notes 22(22/25)	XS2517103250	300	0	0	95,569	286.708,20	0,26
0,3750 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Med.-T. Nts 21(26/27)	XS2416413339	600	0	0	87,324	523.944,00	0,47
0,2500 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Med.-Term Cov. Bds 17(24)	XS1622193248	1.500	0	0	96,440	1.446.603,00	1,31
0,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Preferred MTN 19(24)	XS1956955980	1.000	0	0	97,242	972.420,00	0,88
2,7500 % Deutsche Post AG Medium Term Notes v.13(23)	XS0977496636	1.000	1.000	0	99,704	997.040,00	0,90
0,1250 % Diageo Finance PLC EO-Medium-Term Nts 19(23/23)	XS1982107903	1.000	0	0	98,499	984.990,00	0,89
0,2500 % DNB Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 16(23)	XS1396253236	3.000	3.000	0	99,901	2.997.030,00	2,71
0,8750 % E.ON SE Medium Term Notes v.22(24/25)	XS2463505581	869	600	0	95,623	830.967,35	0,75
2,7500 % Elia Group EO-FLR Nts 18(23/Und.)	BE0002597756	300	0	600	99,250	297.750,00	0,27
0,0000 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Med.-Term Notes 19(19/24)	XS2066706818	1.000	1.000	0	95,933	959.327,00	0,87
0,5000 % Euroclear Bank S.A./N.V. EO-Medium-Term Notes 18(23)	BE6305977074	1.000	0	0	99,208	992.080,00	0,90
4,2500 % FCA Bank S.p.A. EO-Med.-Term Notes 22(24)	XS2549047244	654	654	0	100,383	656.506,78	0,59
0,2500 % Fresenius Medical Care KGaA MTN v.19(23/23)	XS2084510069	1.000	0	0	97,800	978.000,00	0,88
0,1250 % GlaxoSmithKline Cap. PLC EO-Medium-Term Nts 20(23/23)	XS2170609403	1.000	0	0	99,684	996.840,00	0,90
3,9080 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 21(26/27)	XS2389353181	500	0	0	99,000	495.000,00	0,45
3,5450 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 22(24/25)	XS2441551970	1.000	0	0	100,214	1.002.140,00	0,91
5,0000 % Hannover Finance (Lux.) S.A. EO-FLR Notes 12(23/43)	XS0856556807	2.000	0	0	99,871	1.997.420,00	1,81
3,3750 % Hannover Rück SE Sub.-FLR-Bonds.v.14(25/unb.)	XS1109836038	1.000	0	0	95,475	954.748,00	0,86
0,2500 % Heimstaden Bostad Treasury B.V EO-Medium-Term Nts 21(21/24)	XS2397239000	338	0	0	90,460	305.755,14	0,28
0,6250 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.22(22/25)	XS2443921056	300	0	0	94,722	284.165,70	0,26
3,0000 % ING Bank N.V. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 23(26)	XS2585966257	1.400	1.400	0	99,318	1.390.449,20	1,26
1,0000 % ING Groep N.V. EO-Med.-Term Notes 18(23)	XS1882544627	2.000	0	0	98,808	1.976.160,00	1,79
0,5000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hyp.-Pfdr.19(24)	IT0005365231	2.500	0	0	97,293	2.432.325,00	2,20
6,6250 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Medium-Term Notes 13(23)	XS0971213201	1.000	1.000	0	101,000	1.010.000,00	0,91
3,3750 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 23(23/27)	XS2583741934	938	938	0	99,705	935.229,15	0,85
0,6500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 16(23)	IT0005215246	3.000	3.000	0	98,720	2.961.600,00	2,68
0,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 22(23)	IT0005482309	1.000	0	0	98,073	980.730,00	0,89
0,6250 % JPMorgan Chase & Co. EO-Medium-Term Nts 16(23/24)	XS1456422135	1.500	0	0	97,407	1.461.105,00	1,32

Halbjahresbericht für Basis-Fonds I Nachhaltig

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 31.3.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in	%-Anteil am Fonds- vermögen
Währung in 1.000		EUR	EUR	EUR	%	EUR	
4,3750 % KBC Groep N.V.							
EO-FLR Med.-T. Nts 22(26/27)	BE0002900810	400	400	0	100,136	400.542,80	0,36
1,2500 % Kering S.A.							
EO-Med.-Term Notes 22(22/25)	FR001400A5N5	600	0	0	95,761	574.566,00	0,52
4,5000 % LANXESS AG							
FLR-Sub.Anl. v.16(23/76)	XS1405763019	900	0	0	98,500	886.500,00	0,80
0,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE							
EO-Medium-T. Notes 20(20/25)	FR0013506508	600	0	0	94,804	568.824,00	0,51
0,0000 % Medtronic Global Holdings SCA							
EO-Notes 20(20/25)	XS2238787415	906	500	0	92,158	834.953,29	0,76
0,0050 % Merck Financial Services GmbH							
MTN v. 19(19/23)	XS2023643146	1.000	0	0	97,737	977.370,00	0,88
1,6250 % Merck KGaA							
FLR-Sub.Anl. v.19(24/79)	XS2011260531	400	0	0	95,087	380.348,80	0,34
0,2500 % National Australia Bank Ltd.							
EO-Medium-Term Nts 19(24)	XS1998797663	1.000	0	0	96,261	962.606,00	0,87
0,1250 % NatWest Markets PLC							
EO-Medium-Term Notes 21(26)	XS2355599197	1.000	0	0	88,484	884.843,00	0,80
3,8750 % Neste Oyj							
EO-Medium-Term Nts 23(23/29)	XS2598649254	412	412	0	100,985	416.056,55	0,38
4,3750 % Nokia Oyj							
EO-Medium-T. Notes 23(23/31)	XS2488809612	500	500	0	98,935	494.674,99	0,45
3,6250 % Nordea Bank Abp							
EO-FLR Non-Pref. MTN 23(25/26)	XS2584643113	426	426	0	99,715	424.785,90	0,38
0,7500 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V.							
EO-Med.-Term Notes 22(22/25)	XS2441244535	453	0	0	94,986	430.284,32	0,39
3,7500 % Orsted A/S							
EO-Medium-Term Nts 23(23/30)	XS2591029876	946	946	0	100,831	953.864,10	0,86
0,1250 % Santander Consumer Bank AS							
EO-Preferred Med.-T.Nts 21(26)	XS2331216577	1.000	1.000	0	88,791	887.914,00	0,80
0,3750 % Santander Consumer Finance SA							
EO-Preferred MTN 20(25)	XS2100690036	1.000	0	0	94,069	940.689,00	0,85
5,6250 % SES S.A. EO-FLR Nts 16(24/Und.)	XS1405765659	500	500	0	97,750	488.750,00	0,44
0,3750 % Siemens Finan.maatschappij NV							
EO-Medium-Term Notes 18(23)	XS1874127811	800	0	0	98,831	790.648,00	0,72
1,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken							
EO-FLR Med.-T. Nts 16(23/28)	XS1511589605	1.500	0	0	97,625	1.464.375,00	1,32
1,5000 % Société Générale S.A.							
EO-FLR Med.-T. Nts 22(24/25)	FR001400AO22	800	800	0	97,202	777.617,60	0,70
0,0100 % Société Générale SFH S.A.							
EO-M.-T.O.Fin.Hab. 21(26)	FR0014006UI2	2.000	2.000	0	89,038	1.780.766,00	1,61
2,0000 % Société Générale SFH S.A.							
EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.14(24)	FR0011859495	2.000	2.000	0	98,541	1.970.810,00	1,78
0,3500 % Spanien EO-Bonos 18(23)	ES0000012B62	3.000	3.000	0	99,072	2.972.160,00	2,69
0,6250 % Sparebank 1 SR-Bank ASA							
EO-Preferred Med.-T.Nts 19(24)	XS1967582831	2.000	0	0	96,810	1.936.200,00	1,75
1,5000 % Statkraft AS							
EO-Medium-Term Nts 15(23/23)	XS1293571425	1.000	1.000	0	99,112	991.120,00	0,90
0,0000 % Stedin Holding N.V.							
EO-Medium-Term Nts 21(21/26)	XS2407985220	757	500	0	88,914	673.078,98	0,61
0,0500 % Svenska Handelsbanken AB							
EO-Non-Preferred MTN 19(26)	XS2049582542	750	0	0	87,662	657.462,75	0,59
2,9950 % TenneT Holding B.V.							
EO-FLR Securit. 17(24/Und.)	XS1591694481	1.000	0	0	98,049	980.490,04	0,89
1,1250 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V.							
EO-Notes 16(16/24)	XS1439749281	500	500	0	94,964	474.819,99	0,43
0,0640 % Toyota Finance Australia Ltd.							
EO-Medium-Term Notes 22(25)	XS2430285077	305	0	0	94,072	286.919,60	0,26

Gattungsbezeichnung	ISIN	Bestand 31.3.2023	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Stück bzw. Währung in 1.000							
0,0000 % Toyota Motor Finance (Neth.)BV EO-Medium-Term Notes 21(25)	XS2400997131	EUR 610	EUR 0	EUR 0	% 91,497	558.134,14	0,50
1,0000 % UBS Group AG EO-FLR Med.Trm.Nts.22(24/25)	CH1168499791	1.000	0	0	96,557	965.570,00	0,87
0,2500 % UBS Group AG EO-FLR Notes 20(25/26)	CH0520042489	1.000	0	0	92,074	920.735,00	0,83
3,1250 % UniCredit Bank AG HVB MTN-OPF S.2140 v.23(25)	DE000HV2AZG5	2.000	2.000	0	99,697	1.993.940,00	1,80
4,8750 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Med.-T. Nts 19(24/29)	XS1953271225	500	0	0	98,750	493.750,00	0,45
1,0000 % Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Notes 15(23)	XS1241577490	800	0	0	99,559	796.472,00	0,72
0,7500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Nts 22(22/26)	XS2450200824	271	0	0	93,021	252.087,72	0,23
4,2500 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 22(22/30)	XS2550881143	800	800	0	103,355	826.841,60	0,75
1,7500 % Vodafone Group PLC EO-Med.-Term Notes 16(23)	XS1372838679	1.000	0	0	99,348	993.480,00	0,90
2,2500 % Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 15(16/23)	DE000A18V146	1.000	0	0	98,426	984.260,00	0,89
3,0000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 22(22/26)	XS2530756191	400	400	0	98,855	395.419,20	0,36
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						6.074.546,82	5,50
Verzinsliche Wertpapiere						6.074.546,82	5,50
4,2500 % Aquarius & Investments PLC EO- FLR M.-T.LPN13(23/43)Zürich	XS0897406814	EUR 2.000	EUR 0	EUR 0	% 99,500	1.990.000,00	1,80
0,1000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 21(21/25)	XS2308321962	1.000	1.000	0	93,514	935.140,00	0,85
0,2500 % Santander Consumer Bank AG EO Med.-Term Notes 19(24)	XS2063659945	1.000	0	0	94,361	943.610,00	0,85
2,9030 % Thermo Fisher Scient.(Fin.I)BV EO-FLR Notes 21(23)	XS2407911705	1.000	1.000	0	99,969	999.690,00	0,90
3,0000 % Transurban Finance Co. Pty Ltd EO-Medium-Term Nts 20(20/30)	XS2152883406	1.000	1.000	0	94,556	945.558,00	0,86
3,7500 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 23(23/31)	XS2592516210	259	259	0	100,598	260.548,82	0,24
Investmentanteile						3.716.500,00	3,36
Gruppenfremde Investmentanteile						3.716.500,00	3,36
Xtrackers DAX Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0274211480	Stück 25.000	Stück 45.000	Stück 20.000	EUR 148,660	3.716.500,00	3,36
Summe Wertpapiervermögen						106.261.540,44	96,13

Gattungsbezeichnung			Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds			3.585.042,46	3,24
Bankguthaben			3.585.042,46	3,24
EUR-Guthaben bei:				
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			3.548.372,36	3,21
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen bei:				
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main	NOK	76.198,90	6.696,74	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:				
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main	GBP	3.938,76	4.482,49	0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main	USD	27.694,56	25.490,87	0,02
Sonstige Vermögensgegenstände			741.506,83	0,67
Zinsansprüche			740.987,71	0,67
Sonstige Forderungen			519,12	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten			./45.639,89	./0,04
Verwaltungsvergütung			./36.191,98	./0,03
Verwahrstellenvergütung			./2.741,06	0,00
Prüfungskosten			./4.487,67	0,00
Veröffentlichungskosten			./2.219,18	0,00
Fondsvermögen			110.542.449,84	100,00¹⁾
Anteilwert	EUR	138,98		
Ausgabepreis	EUR	138,98		
Anteile im Umlauf	Stück	795.375		

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

Britisches Pfund	GBP	1 EUR =	0,8787000	US-Dollar	USD	1 EUR =	1,0864500
Norwegische Krone	NOK	1 EUR =	11,3785000				

¹⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

Gattungsbezeichnung Stück bzw. Währung in 1.000	ISIN	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere			
Verzinsliche Wertpapiere			
3,7500 % ATF Netherlands B.V. EO-FLR Notes 16(23/Und.)	XS1508392625	EUR 0	EUR 500
3,0000 % Bertelsmann SE & Co. KGaA FLR-Sub.Anl. v.15(23/75)	XS1222591023	0	800
1,9360 % Commonwealth Bank of Australia EO-FLR Med.-T. Nts 17(24/29)	XS1692332684	0	1.000
4,0000 % Deutsche Bank AG Med.Term Nts.v.22(2027)	DE000A30VQ09	300	300
0,3750 % E.ON SE Medium Term Notes v.20(23/23)	XS2177575177	0	600
4,4960 % EDP - Energias de Portugal SA EO-FLR Securities 19(24/79)	PTEDPKOM0034	0	500
0,6250 % FMO-Ned.Fin.-Maat.is v.Ontw.NV EO-FLR Med.-T. Nts 20(25/31)	XS2205081966	0	1.000
4,1250 % Naturgy Finance B.V. EO-FLR Securit. 14(22/Und.)	XS1139494493	0	1.400
0,7500 % Nestlé Finance Intl Ltd. EO-Medium-Term Nts.15(15/23)	XS1319652902	0	1.000
1,1250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Notes 17(23)	XS1586555861	0	1.000
0,3750 % Volkswagen Leasing GmbH Med.Term Nts.v.21(26)	XS2343822842	0	339
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere			
Verzinsliche Wertpapiere			
3,0490 % Amadeus IT Group S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 22(23/24)	XS2432941008	EUR 0	EUR 500
0,6250 % Barclays PLC EO-FLR Med.-Term Nts 17(17/23)	XS1716820029	0	1.000
0,6250 % Deutsche Telekom Intl Fin.B.V. EO-Medium-Term Notes 18(22)	XS1828032513	0	1.060
1,0000 % Evonik Industries AG Medium Term Notes v.15(22/23)	XS1170787797	0	1.000
Nichtnotierte Wertpapiere²⁾			
Verzinsliche Wertpapiere			
2,2500 % Alliander N.V. EO-Medium-Term Notes 12(22)	XS0854759080	EUR 0	EUR 1.300
5,6250 % Allianz SE FLR-Sub.Anl.v.12(22/42)	DE000A1RE1Q3	0	1.000
7,7500 % Assicurazioni Generali S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 12(22/42)	XS0863907522	0	1.000
2,5750 % Crédit Agricole S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 18(23)	XS1787278008	0	1.300
0,3240 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 17(22/23)	XS1681855539	0	1.000
0,3750 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 19(19/23)	XS1944456018	0	1.279
0,9500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 18(23)	IT0005325946	2.000	3.000
0,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 20(22)	IT0005440679	0	2.000
0,3750 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 19(19/23)	XS1960678099	0	500
0,7500 % Santander Consumer Bank AS EO-Medium-Term Notes 18(23)	XS1781346801	0	1.000
2,5000 % Statkraft AS EO-Medium-Term Nts 12(22)	XS0858366684	0	1.500
2,6250 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 17(23/Und.)	XS1731823255	0	600
4,8500 % Volvo Treasury AB EO-FLR Capit. Secs 14(23/78)	XS1150695192	0	1.000
Investmentanteile			
Gruppenfremde Investmentanteile			
Xtrackers Euro Stoxx 50 Inhaber-Anteile 1D o.N.	LU0274211217	Stück 60.000	Stück 60.000

Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

Volumen in 1.000

Terminkontrakte**Zinsterminkontrakte**

verkaufte Kontrakte:

(Basiswert[e]: EURO-BOBL, EURO-SCHATZ)

EUR

698.735,82

²⁾ Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	96,13
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,00

Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	138,98
Ausgabepreis	EUR	138,98
Anteile im Umlauf	Stück	795.375

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände**Bewertung**

Gemäß den Vorschriften der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung (KARBV) aktualisiert ODDO BHF Asset Management GmbH (ODDO BHF AM GmbH) als Kapitalverwaltungsgesellschaft (KVG) die im Hause verwendeten Bewertungspreise aller gehaltenen Instrumente durch geeignete Prozesse auf täglicher Basis.

Die Pflege der Bewertungspreise erfolgt handelsunabhängig.

Um der Vielfaltigkeit der unterschiedlichen Instrumente Rechnung zu tragen, werden die genutzten Verfahren in einem Pricing Committee in regelmäßigen Abständen vorgestellt, überprüft und ggf. adjustiert. Das Pricing Committee hat die folgenden Aufgaben und Ziele:

Aufgaben

- Festlegung der Bewertungsprozesse sowie der Kursquellen der einzelnen Assetklassen
- Regelmäßige Überprüfung der festgelegten Bewertungs-/ Überwachungsprozesse (z.B. bei fehlenden Preisen (Missing Prices), wesentlichen Kursprüngen (Price Movements), über längere Zeit unveränderten Kursen (Stale Prices)) sowie der präferierten Kursquellen
- Entscheidung über das Vorgehen bei vom Standardprozess abweichenden Bewertungen
- Entscheidung über Bewertungsverfahren bei Sonderfällen (z.B. illiquide Wertpapiere)

Ziele

- Kommunikation der bestehenden Prozesse zur Ermittlung der Bewertungspreise an die beteiligten Bereiche
- Fortlaufende Optimierung der Prozesse zur Ermittlung der Bewertungspreise

Bei Einrichtung wird jedes Instrument gemäß seinen Ausstattungsmerkmalen einem Prozess für die Kursversorgung zugeordnet. Dieser beinhaltet die Festlegung des Datenlieferanten, des Aktualisierungsintervalls, die Auswahl der Preisquellen sowie das generelle Vorgehen.

Neben automatisierten Schnittstellenbelieferungen über Bloomberg und Reuters werden auch andere geeignete Kurs- und Bewertungsquellen zur Bewertung von Instrumenten herangezogen. Dies erfolgt in Fällen, bei denen über die Standardkursquellen keine adäquaten Bewertungen verfügbar sind. Zusätzlich kann auf Bewertungen von Arrangeuren (z.B. bei Asset Backed Securities) zurückgegriffen werden.

Um fortlaufend eine hochwertige Kursversorgung zu gewährleisten, wurden standardisierte Prüfroutinen zur Qualitätssicherung implementiert.

Die Bewertungen der einzelnen Vermögensgegenstände stellen sich wie folgt dar:

An einer Börse zugelassene/in organisiertem Markt gehandelte Vermögensgegenstände

Vermögensgegenstände, die zum Handel an Börsen zugelassen sind oder in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, sowie Bezugsrechte werden zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet, sofern nachfolgend nicht anders angegeben.

Nicht an Börsen notierte oder organisierten Märkten gehandelte Vermögensgegenstände oder Vermögensgegenstände ohne handelbaren Kurs

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist, sofern nachfolgend nicht anders angegeben. Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

Nichtnotierte Schuldverschreibungen und Schuldscheindarlehen

Für die Bewertung von Schuldverschreibungen, die nicht zum Handel an der Börse zugelassen oder in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind (z.B. nicht notierte Anleihen, Commercial Papers und Einlagenzertifikate), und für die Bewertung von Schuldscheindarlehen werden die für vergleichbare Schuldverschreibungen und Schuldscheindarlehen vereinbarten Preise und gegebenenfalls die Kurswerte von Anleihen vergleichbarer Aussteller mit entsprechender Laufzeit und Verzinsung, erforderlichenfalls mit einem Abschlag zum Ausgleich der geringeren Veräußerbarkeit, herangezogen.

Geldmarktinstrumente

Bei Geldmarktinstrumenten kann die KVG die Anteilpreisberechnung unter Hinzurechnung künftiger Zinsen und Zinsbestandteile bis einschließlich des Kalendertages vor dem Valutatag vornehmen. Dabei sind die auf der Ertragsseite zu erfassenden Zinsabgrenzungen je Anlage zu berücksichtigen. Für die Aufwandsseite können alle noch nicht fälligen Leistungen der KVG, wie Verwaltungsvergütungen, Verwahrstellengebühren, Prüfungskosten, Kosten der Veröffentlichung etc., einbezogen werden, die den Anteilpreis beeinflussen.

Bei den im Fonds befindlichen Geldmarktinstrumenten können Zinsen und zinsähnliche Erträge sowie Aufwendungen (z.B. Verwaltungsvergütung, Verwahrstellenvergütung, Prüfungskosten, Kosten der Veröffentlichung etc.) bis einschließlich des Tages vor dem Valutatag berücksichtigt werden.

Optionsrechte und Terminkontrakte

Die zu einem Fonds gehörenden Optionsrechte und die Verbindlichkeiten aus einem Dritten eingeräumten Optionsrechten, die zum Handel an einer Börse zugelassen oder in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind, werden zu dem jeweils letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet.

Das gleiche gilt für Forderungen und Verbindlichkeiten aus für Rechnung des Fonds verkauften Terminkontrakten. Die zu Lasten des Fonds geleisteten Einschüsse werden unter Einbeziehung der am Börsentag festgestellten Bewertungsgewinne und Bewertungsverluste zum Wert des Fonds hinzurechnet.

Bankguthaben, Festgelder, Investmentanteile und Darlehen

Bankguthaben werden grundsätzlich zu ihrem Nennwert zuzüglich zugeflossener Zinsen bewertet.

Festgelder werden zum Verkehrswert bewertet, sofern das Festgeld jederzeit kündbar ist und die Rückzahlung bei der Kündigung nicht zum Nennwert zuzüglich Zinsen erfolgt.

Investmentanteile werden grundsätzlich mit ihrem letzten festgestellten Rücknahmepreis angesetzt oder zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet. Stehen diese Werte nicht zur Verfügung, werden Investmentanteile zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Für die Rückerstattungsansprüche aus Darlehensgeschäften ist der jeweilige Kurswert der als Darlehen übertragenen Vermögensgegenstände maßgebend.

Auf ausländische Währung lautende Vermögensgegenstände

Auf ausländische Währung lautende Vermögensgegenstände werden zum 17:00 Uhr-Fixing des Bewertungstages der World Market Rates (Quelle: Datastream) umgerechnet.

Düsseldorf, den 3. April 2023

ODDO BHF Asset Management GmbH
Die Geschäftsführung

Kurzübersicht über die Partner des Basis-Fonds | Nachhaltig

ODDO BHF Asset Management GmbH

Herzogstraße 15
40217 Düsseldorf
Postanschrift:
Postfach 10 53 54, 40044 Düsseldorf
Telefon: +49 (0) 211 2 39 24 - 01

Zweigstelle Frankfurt am Main
Bockenheimer Landstraße 10
60323 Frankfurt am Main
Postanschrift:
Postfach 11 07 61, 60042 Frankfurt am Main
Telefon: +49 (0) 69 9 20 50 - 0
Telefax: +49 (0) 69 9 20 50 - 103

Gezeichnetes und eingezahltes Eigenkapital:
10,3 Mio. EUR

Gesellschafter von ODDO BHF Asset Management GmbH
ist zu 100% die ODDO BHF SE

VERWAHRSTELLE

The Bank of New York Mellon SA/NV
Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main
MesseTurm, Friedrich-Ebert-Anlage 49
60327 Frankfurt am Main

Haftendes Kern- und Ergänzungskapital:
3,3 Mrd. EUR

GESCHÄFTSFÜHRUNG

Nicolas Chaput

Sprecher
Zugleich Präsident der ODDO BHF
Asset Management SAS und der
ODDO BHF Private Equity SAS

Dr. Stefan Steurer

Philippe de Lobkowicz

Zugleich Mitglied des Verwaltungsrats der
ODDO BHF Asset Management Lux

AUFSICHTSRAT

Werner Taiber

Vorsitzender
Düsseldorf, Vorsitzender des Aufsichtsrats der
ODDO BHF SE, Frankfurt am Main

Grégoire Charbit

Paris, Vorstand der ODDO BHF SE,
Frankfurt am Main und ODDO BHF SCA, Paris

Christophe Tadié

Frankfurt am Main, Vorstand der ODDO BHF SE und
ODDO BHF SCA, Vorsitzender des Vorstands (CEO)
der ODDO BHF Corporates & Markets AG

Joachim Häger

Friedrichsdorf, Vorstand der ODDO BHF SE, Frankfurt am Main
und der ODDO BHF SCA, Paris, Präsident des Verwaltungsrats der
ODDO BHF (Schweiz) AG, Zürich

Michel Haski

Lutry, Unabhängiger Aufsichtsrat

Olivier Marchal

Suresnes, Vorsitzender von Bain & Company France und
Vorsitzender des Aufsichtsrats der ODDO BHF SCA, Paris

Monika Vicandi

Triesenberg, Vorstand der ODDO BHF SE, Frankfurt am Main

Alle Angaben Stand Februar 2023

ODDO BHF Asset Management GmbH

Herzogstraße 15
40217 Düsseldorf
Postanschrift:
Postfach 10 53 54
40044 Düsseldorf

Zweigstelle Frankfurt am Main
Bockenheimer Landstraße 10
60323 Frankfurt am Main
Postanschrift:
Postfach 11 07 61
60042 Frankfurt am Main
Telefon +49 (0) 69 9 20 50 - 0
Telefax +49 (0) 69 9 20 50 - 103

am.oddo-bhf.com



ODDO BHF
ASSET MANAGEMENT