



**ODDO BHF**  
ASSET MANAGEMENT

# *Halbjahresbericht*

Basis-Fonds | Nachhaltig

Vertrieb und Initiator



31. März 2024

# Vermögensübersicht zum 31.3.2024

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	In % vom Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>216.903.062,67</b>	<b>100,07</b>
1. Anleihen	210.375.822,73	97,06
< 1 Jahr	64.502.166,59	29,76
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	63.331.370,26	29,22
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	28.594.689,28	13,19
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	35.509.762,20	16,38
>= 10 Jahre	18.437.834,40	8,51
2. Derivate	-17.500,00	-0,01
3. Bankguthaben	4.253.057,69	1,96
4. Sonstige Vermögensgegenstände	2.291.682,25	1,06
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-150.554,38</b>	<b>-0,07</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>216.752.508,29</b>	<b>100,00</b>

# Vermögensaufstellung zum 31.3.2024

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 31.3.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE</b>						<b>179.757.920,37</b>	<b>82,93</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>						<b>179.757.920,37</b>	<b>82,93</b>
3,6250 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Preferred MTN 23(26) XS2573331324	EUR	1.000	0	0	100,443 %	1.004.430,00	0,46
2,2410 % Allianz SE FLR-Sub.Anl.v.15(25/45) DE000A14J9N8	EUR	2.000	1.000	0	97,682 %	1.953.632,00	0,90
3,2500 % Arkéa Home Loans SFH S.A. EO-Mortg.Cov.MTN 23(33) FR001400ICR2	EUR	2.000	0	0	102,161 %	2.043.216,00	0,94
3,8750 % Assa-Abloy AB EO-Med.-T. Nts 23(23/30) XS2678226114	EUR	622	0	0	103,499 %	643.764,40	0,30
3,5000 % AT & T Inc. EO-Notes 13(13/25) XS0993148856	EUR	1.000	0	0	99,847 %	998.470,00	0,46
0,2500 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-Med.-Term Cov. Bds 22(25) XS2456253082	EUR	1.273	0	0	96,922 %	1.233.814,51	0,57
3,9410 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 14(24/Und.) XS1134541306	EUR	1.000	0	0	99,125 %	991.250,00	0,46
4,9450 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Med.-Term Nts 22(25) XS2485259670	EUR	500	0	0	101,294 %	506.470,00	0,23
0,1250 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Preferred MTN 21(26/27) XS2322289385	EUR	1.000	0	0	93,344 %	933.443,00	0,43
4,8840 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(24) XS2476266205	EUR	500	0	0	100,069 %	500.345,00	0,23
0,3000 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 19(26) XS2063247915	EUR	1.000	1.000	0	92,646 %	926.455,00	0,43
1,7760 % Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 17(17/27) XS1602547264	EUR	1.000	0	0	96,245 %	962.450,00	0,44
4,9220 % Bank of America Corp. EO-FLR Med.-T. Nts 21(25/26) XS2387929834	EUR	2.000	0	0	100,839 %	2.016.780,00	0,93
4,8980 % Barclays PLC EO-FLR Med.-T. Nts 21(25/26) XS2342059784	EUR	1.000	1.000	0	100,547 %	1.005.470,00	0,46
4,1070 % Berlin Hyp AG FLR-Hyp.-Pfdb. 24(26) DE000BHYOGZ4	EUR	2.000	2.000	0	99,993 %	1.999.860,00	0,92
3,5000 % Bertelsmann SE & Co. KGaA MTN v.22(22/29) XS2560753936	EUR	700	0	0	100,270 %	701.890,70	0,32
0,0000 % BMW Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 21(26) XS2280845491	EUR	758	0	0	94,480 %	716.159,92	0,33
0,3750 % BNP Paribas Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.15(25) FR0012716371	EUR	1.100	0	0	96,570 %	1.062.272,20	0,49
1,0000 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 17(24) XS1637277572	EUR	1.000	0	0	99,312 %	993.120,00	0,46

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 31.3.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
4,6250 % BPCE S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 23(29/30) FR001400G6Y4	EUR	500	0	0	103,924 %	519.619,00	0,24
0,6250 % BPCE S.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 20(25) FR0013509726	EUR	1.000	0	0	96,854 %	968.543,00	0,45
3,2500 % BPCE SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.23(28) FR001400H8X1	EUR	3.000	0	0	100,725 %	3.021.750,00	1,39
3,0000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 214(24) XS1069549761	EUR	700	700	0	99,750 %	698.250,00	0,32
4,1250 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Medium-Term Notes 23(29) FR001400GGZ0	EUR	800	0	0	103,057 %	824.456,00	0,38
3,7500 % British Telecommunications PLC EO-Med.-Term Notes 23(23/31) XS2582814039	EUR	435	0	0	101,506 %	441.551,97	0,20
1,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.22 (38) DE0001102598	EUR	2.500	5.000	2.500	82,969 %	2.074.225,00	0,96
0,2000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.22(24) DE0001104883	EUR	5.000	5.000	0	99,296 %	4.964.800,00	2,29
2,5000 % Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. v.24(26) DE000BU22049	EUR	2.000	2.000	0	99,349 %	1.986.980,00	0,92
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/05 f.17.04.24 DE000BU0E048	EUR	4.000	0	0	99,860 %	3.994.400,00	1,84
6,3750 % C.N.d.Reas.Mut.Agrico.Group.SA EO-FLR Notes 14(24/Und.) FR0011896513	EUR	1.500	500	0	100,000 %	1.500.000,00	0,69
3,5000 % Carlsberg Breweries A/S EO-Medium-Term Nts 23(23/26) XS2624683301	EUR	550	0	0	100,332 %	551.826,55	0,25
4,3750 % Carrier Global Corp. EO-Nts 24(24/25) XS2751688743	EUR	981	981	0	100,550 %	986.393,54	0,46
4,2500 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Notes 14(25/45) FR0011949403	EUR	700	0	0	100,044 %	700.308,00	0,32
5,2500 % Commerzbank AG FLR-MTN Serie 1018 v.23(28/29) DE000CZ439B6	EUR	300	0	0	104,857 %	314.569,50	0,15
3,1250 % Commerzbank AG MTH S.P61 v.23(29) DE000CZ43ZX7	EUR	2.000	0	0	100,881 %	2.017.618,00	0,93
1,9360 % Commonwealth Bank of Australia EO-FLR Med.-T. Nts 17(24/29) XS1692332684	EUR	1.000	1.000	0	98,481 %	984.810,00	0,45
1,6250 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EO-Medium-Term Notes 22(22/25) XS2517103250	EUR	1.000	0	0	97,308 %	973.083,00	0,45
3,2500 % Compass Group PLC EO-Medium-Term Nts 24(24/31) XS2758114321	EUR	351	351	0	100,000 %	351.001,05	0,16

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 31.3.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
0,3750 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Med.-T. Nts 21(26/27) XS2416413339	EUR	1.600	1.000	0	91,965 %	1.471.440,00	0,68
0,7500 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Med.-T.Cov.Bonds 22(32) XS2449505820	EUR	1.500	1.500	0	85,235 %	1.278.525,00	0,59
0,2500 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Med.-Term Cov. Bds 17(24) XS1622193248	EUR	1.000	1.000	1.500	99,440 %	994.400,00	0,46
3,2500 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.23(26) FR001400G5S8	EUR	2.500	0	0	100,347 %	2.508.665,00	1,16
1,6250 % Crédit Agricole S.A. EO-FLR Med.-Term Nts 20(25/30) FR0013516184	EUR	1.500	700	0	96,900 %	1.453.498,50	0,67
1,8750 % Crédit Mutuel Arkéa EO-FLR Med.-T.Nts 17(24/29) FR0013291556	EUR	1.000	0	0	98,365 %	983.650,00	0,45
3,8750 % Crédit Mutuel Arkéa EO-Preferred MTN 23(28) FR001400I186	EUR	500	0	0	101,757 %	508.782,50	0,23
3,1250 % Crédit Mutuel Home Loan SFH SA EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.23(27) FR001400FZ24	EUR	2.000	0	0	100,238 %	2.004.768,00	0,92
1,0000 % Danone S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 21(21/Und.) FR0014005EJ6	EUR	800	800	0	92,043 %	736.340,80	0,34
1,0000 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.20(24/25) DE000DL19VR6	EUR	1.000	0	0	98,047 %	980.470,00	0,45
3,8750 % Deutsche Börse AG Anleihe v.23(23/26) DE000A351ZR8	EUR	800	0	0	101,362 %	810.892,00	0,37
3,8750 % Deutsche Börse AG Anleihe v.23(23/33) DE000A351ZT4	EUR	1.000	1.000	0	104,850 %	1.048.500,00	0,48
3,7500 % Deutsche Lufthansa AG MTN v.21(27/28) XS2296203123	EUR	1.000	1.000	0	99,123 %	991.230,00	0,46
3,6250 % DNB Bank ASA EO-FLR Non-Pref. MTN 23(26/27) XS2588099478	EUR	1.000	0	0	99,930 %	999.301,00	0,46
0,0100 % DNB Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 21(31) XS2289593670	EUR	1.000	0	1.500	82,263 %	822.626,00	0,38
3,8750 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1262 23(24) DE000A3MQU94	EUR	2.000	2.000	0	99,988 %	1.999.760,00	0,92
0,8750 % E.ON SE Medium T. Notes v.22(24/25) XS2463505581	EUR	869	0	0	97,832 %	850.160,08	0,39
3,5000 % E.ON SE Medium T. Notes v.23(27/28) XS2574873266	EUR	500	0	0	101,163 %	505.814,50	0,23
0,0000 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Med.-Term Notes 19(19/24) XS2066706818	EUR	1.500	0	0	99,206 %	1.488.090,00	0,69
3,3750 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Medium-Term Notes 24(24/28) XS2751666426	EUR	758	758	0	100,168 %	759.273,44	0,35

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 31.3.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
3,5000 % ENEL S.p.A. EO-FLR Cap. Secs 19(25/UND) XS2000719992	EUR	500	500	0	98,784 %	493.922,00	0,23
3,6250 % Engie S.A. EO-Med.-T. Nts 23(23/26) FRO01400MF78	EUR	700	700	0	100,409 %	702.863,00	0,32
Europäische Union EO-Bills Tr. 7.6.2024 EU000A3K4EP0	EUR	3.000	3.000	0	99,312 %	2.979.360,00	1,37
0,0000 % Europäische Union EO-Med.-T. Notes 21(28) EU000A3KWCF4	EUR	4.000	0	0	88,617 %	3.544.672,00	1,64
0,4500 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 21(41) EU000A3KT6B1	EUR	1.600	1.600	0	64,585 %	1.033.360,00	0,48
3,2500 % Europäische Union EO-Medium-Term Notes 23(34) EU000A3K4D41	EUR	3.000	3.000	0	103,361 %	3.100.815,00	1,43
2,7500 % Finnland, Republik EO-Bonds 23(38) FI4000546528	EUR	3.000	1.500	0	97,483 %	2.924.502,00	1,35
4,0000 % Fortum Oyj EO-Med.-T. Nts 23(23/28) XS2606264005	EUR	697	500	0	101,536 %	707.704,53	0,33
1,3750 % GlaxoSmithKline Cap. PLC EO-Medium-Term Notes 14(24) XS1147605791	EUR	1.000	0	0	98,434 %	984.340,00	0,45
4,9260 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 21(26/27) XS2389353181	EUR	500	0	0	101,428 %	507.140,00	0,23
3,3750 % Hannover Rück SE Sub.-FLR-Bonds.v.14(25/unb.) XS1109836038	EUR	2.000	1.000	0	98,934 %	1.978.670,00	0,91
1,0000 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Med.-Term Notes 17(24/25) XS1575444622	EUR	1.000	0	0	97,545 %	975.448,00	0,45
0,3750 % Iberdrola International B.V. EO-Medium-Term Notes 16(25) XS1490726590	EUR	400	400	0	95,664 %	382.654,80	0,18
0,6250 % Infineon Technologies AG Medium Term Notes v.22(22/25) XS2443921056	EUR	300	0	0	97,354 %	292.062,00	0,13
3,0000 % ING Bank N.V. EO-M.-T. Mortg.Cov.Bds 23(26) XS2585966257	EUR	1.400	0	0	99,561 %	1.393.848,40	0,64
1,6250 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 17(24/29) XS1689540935	EUR	1.000	1.000	0	98,520 %	985.200,00	0,45
1,0000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 19(25/30) XS2079079799	EUR	1.000	1.000	0	94,984 %	949.843,90	0,44
3,0500 % Instituto de Credito Oficial EO-Medium-Term Nts 24(31) XS2793252060	EUR	2.451	2.451	0	100,194 %	2.455.754,94	1,13
3,3750 % Intl Business Machines Corp. EO-Notes 23(23/27) XS2583741934	EUR	938	0	0	100,398 %	941.729,49	0,43

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 31.3.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
1,5000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 15(25) IT0005090318	EUR	5.000	5.000	0	97,871 %	4.893.550,00	2,26
1,7500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 19(24) IT0005367492	EUR	1.000	0	0	99,490 %	994.902,00	0,46
1,7500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 22(24) IT0005499311	EUR	4.000	4.000	0	99,657 %	3.986.280,00	1,84
4,2000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 23(34) IT0005560948	EUR	3.000	3.000	0	104,523 %	3.135.690,00	1,45
2,9500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 24(27) IT0005580045	EUR	3.000	3.000	0	99,466 %	2.983.983,00	1,38
1,5000 % JPMorgan Chase & Co. EO-Medium-Term Notes 15(25) XS1174469137	EUR	2.000	2.000	0	98,283 %	1.965.660,00	0,91
1,6250 % KBC Groep N.V. EO-FLR Med.-T.Nts 17(24/29) BE0002290592	EUR	1.500	1.500	0	98,509 %	1.477.635,00	0,68
1,2500 % Kering S.A. EO-Med.-T. Nts 22(22/25) FR001400A5N5	EUR	600	0	0	97,455 %	584.730,00	0,27
0,7500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.18(28) DE000A2LQSH4	EUR	2.500	0	0	92,285 %	2.307.117,50	1,06
4,6250 % Logicor Financing S.à.r.l. EO-Medium-Term Nts 24(24/28) XS2753547673	EUR	656	656	0	101,233 %	664.085,20	0,31
0,7500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 20(20/25) FR0013506508	EUR	600	0	0	97,336 %	584.016,00	0,27
3,2500 % LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE EO-Medium-Term Notes 23(23/29) FR001400KJP7	EUR	1.000	0	0	101,186 %	1.011.859,00	0,47
0,0000 % Medtronic Global Holdings SCA EO-Notes 20(20/25) XS2238787415	EUR	906	0	0	94,758 %	858.509,29	0,40
1,6250 % Merck KGaA FLR-Sub.Anl. v.19(24/79) XS2011260531	EUR	400	0	0	97,750 %	391.000,00	0,18
1,5000 % Mondi Finance PLC EO-Med.-Term Notes 16(24/24) XS1395010397	EUR	800	0	0	99,916 %	799.328,00	0,37
1,6250 % Mondi Finance PLC EO-Med.-Term Notes 18(26/26) XS1813593313	EUR	1.000	0	0	96,100 %	961.000,00	0,44
3,8930 % Münchener Hypothekenbank FLR-MTN HPF R.35 v.23(25) DE000MHB4875	EUR	2.000	0	0	99,926 %	1.998.520,00	0,92
0,2500 % National Australia Bank Ltd. EO-Medium-Term Nts 19(24) XS1998797663	EUR	1.000	0	0	99,508 %	995.080,00	0,46
1,0000 % National Grid North Amer. Inc. EO-Medium-Term Notes 17(24) XS1645494375	EUR	1.000	0	0	99,179 %	991.790,00	0,46
0,1250 % NatWest Markets PLC EO-Medium-Term Notes 21(26) XS2355599197	EUR	1.000	0	0	93,079 %	930.794,00	0,43

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 31.3.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
3,8750 % Neste Oyj EO-Med.-T. Nts 23(23/29) XS2598649254	EUR	412	0	0	102,157 %	420.888,08	0,19
3,8750 % Neste Oyj EO-Med.-Term Nts 23(23/31) XS2718201515	EUR	410	410	0	102,395 %	419.819,50	0,19
1,6250 % NGG Finance PLC EO-FLR Nts 19(24/79) XS2010044977	EUR	500	0	0	98,000 %	490.000,00	0,23
3,6250 % Nordea Bank Abp EO-FLR Non-Pref. MTN 23(25/26) XS2584643113	EUR	426	0	0	99,697 %	424.709,22	0,20
2,6250 % Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 22(25) XS2561746855	EUR	2.000	0	0	98,982 %	1.979.648,00	0,91
0,7500 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-Term Notes 22(22/25) XS2441244535	EUR	1.000	0	0	97,178 %	971.782,00	0,45
5,1250 % Orsted A/S EO-FLR M.-T. Nts 24(24/Und.) XS2778385240	EUR	426	426	0	100,250 %	427.065,00	0,20
2,2500 % Orsted A/S EO-Med.-Term Nts 22(22/28) XS2490471807	EUR	500	0	0	95,811 %	479.057,00	0,22
3,7500 % Orsted A/S EO-Med.-Term Nts 23(23/30) XS2591029876	EUR	946	0	0	101,774 %	962.783,93	0,44
0,0000 % Österreich, Republik EO-Medium-Term Notes 22(28) AT0000A2VB47	EUR	4.000	0	0	88,738 %	3.549.536,00	1,64
3,3750 % RELX Finance B.V. EO-Nts 24(24/33) XS2779010300	EUR	538	538	0	100,231 %	539.242,78	0,25
0,1250 % Santander Consumer Bank AS EO-Preferred Med.-T.Nts 21(26) XS2331216577	EUR	1.000	0	0	92,926 %	929.264,00	0,43
0,3750 % Santander Consumer Finance SA EO-Preferred MTN 20(25) XS2100690036	EUR	1.000	0	0	97,420 %	974.200,00	0,45
3,0000 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Med.-Term Nts 24(28/28) XS2769892519	EUR	1.500	1.500	0	100,149 %	1.502.235,00	0,69
0,2500 % Siemens Finan.maatschappij NV EO-Medium-Term Notes 20(24) XS2182055181	EUR	1.500	0	0	99,436 %	1.491.540,00	0,69
3,7500 % Sika Capital B.V. EO-Notes 23(23/26) XS2616008541	EUR	567	0	0	100,833 %	571.724,81	0,26
3,2500 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Med.-Term Cov. Bds 23(25) XS2623820953	EUR	2.000	0	0	99,895 %	1.997.908,00	0,92
4,0000 % Snam S.p.A. EO-Med.-T. Nts 23(23/29) XS2725959683	EUR	706	706	0	102,623 %	724.521,20	0,33
1,5000 % Société Générale S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 22(24/25) FR001400AO22	EUR	800	0	0	99,600 %	796.800,00	0,37
0,0100 % Société Générale SFH S.A. EO-M.-T.O.Fin.Hab. 21(26) FR0014006UI2	EUR	2.000	0	0	92,244 %	1.844.886,00	0,85
2,0000 % Société Générale SFH S.A. EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.14(24) FR0011859495	EUR	2.000	0	0	99,857 %	1.997.140,00	0,92



FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 31.3.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
3,5500 % Spanien EO-Bonos 23(33) ES0000012L78	EUR	3.000	1.500	0	103,630 %	3.108.909,00	1,43
3,1250 % Statkraft AS EO-Med.-T. Nts 23(23/26) XS2723597923	EUR	1.500	1.500	0	99,628 %	1.494.414,00	0,69
0,0000 % Stedin Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 21(21/26) XS2407985220	EUR	757	0	0	91,166 %	690.126,62	0,32
0,0500 % Svenska Handelsbanken AB EO-Non-Preferred MTN 19(26) XS2049582542	EUR	750	0	0	92,440 %	693.299,25	0,32
2,8800 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Notes 21(28/Und.) XS2410367747	EUR	1.000	1.000	0	92,145 %	921.448,00	0,43
2,3740 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 20(20/Und.) XS2207430120	EUR	1.000	1.000	0	96,903 %	969.028,00	0,45
2,9950 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Securit. 17(24/Und.) XS1591694481	EUR	1.000	0	0	99,625 %	996.250,00	0,46
0,7500 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 17(17/25) XS1632897762	EUR	1.000	0	0	97,465 %	974.649,00	0,45
0,0640 % Toyota Finance Australia Ltd. EO-Medium-Term Notes 22(25) XS2430285077	EUR	805	500	0	97,180 %	782.299,00	0,36
0,0000 % Toyota Motor Finance (Neth.)BV EO-Medium-Term Notes 21(25) XS2400997131	EUR	610	0	0	94,929 %	579.063,85	0,27
0,2500 % UBS Group AG EO-FLR Notes 20(25/26) CH0520042489	EUR	1.000	0	0	96,922 %	969.220,00	0,45
3,1250 % UniCredit Bank GmbH HVB MTN-OPF S.2140 v.23(25) DE000HV2AZG5	EUR	2.000	0	0	99,616 %	1.992.316,00	0,92
1,2000 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 20(25/26) XS2104967695	EUR	1.000	0	0	97,801 %	978.010,00	0,45
3,5000 % UniCredit S.p.A. EO-Mortg. Cov. MTN 23(30) IT0005549370	EUR	2.000	0	0	101,650 %	2.033.004,00	0,94
1,2500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Nts 20(20/25) XS2147133495	EUR	1.000	0	0	97,762 %	977.623,00	0,45
0,7500 % Unilever Fin. Netherlands B.V. EO-Medium-Term Nts 22(22/26) XS2450200824	EUR	271	0	0	95,624 %	259.142,12	0,12
4,0000 % Universal Music Group N.V. EO-Medium-Term Nts 23(23/31) XS2631848665	EUR	579	0	0	103,478 %	599.135,30	0,28
0,9000 % Verbund AG EO- Notes 21(21/41) XS2320746394	EUR	800	800	0	67,337 %	538.696,00	0,25
4,2500 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 22(22/30) XS2550881143	EUR	800	0	0	104,950 %	839.598,40	0,39

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 31.3.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)</b>							
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
2,5000 % Volkswagen Bank GmbH Med.Term.Nts.v.19(26) XS1944390597	EUR	1.000	1.000	0	97,261 %	972.613,00	0,45
3,3750 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-FLR Notes 18(24/Und.) XS1799938995	EUR	1.000	1.000	0	99,250 %	992.500,00	0,46
3,1250 % Volvo Treasury AB EO-Med.-T.Notes 24(24/26) XS2760218185	EUR	810	810	0	99,073 %	802.491,30	0,37
0,0000 % Vonovia SE Medium Term Notes v.21(21/24) DE000A3E5MF0	EUR	600	600	0	98,158 %	588.948,00	0,27
3,0000 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 22(22/26) XS2530756191	EUR	400	0	0	99,326 %	397.302,80	0,18
AN ORGANISIERTEN MÄRKTEN ZUGELASSENE ODER IN DIESE EINBEZOGENE WERTPAPIERE						30.617.902,36	14,13
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>						<b>30.617.902,36</b>	<b>14,13</b>
3,1250 % ABB Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 24(24/29) XS2747181969	EUR	716	716	0	100,270 %	717.935,35	0,33
3,2480 % Abertis Infrastruct. Fin. BV EO-FLR Notes 20(25/Und.) XS2256949749	EUR	800	800	0	96,749 %	773.990,40	0,36
3,6250 % ASR Nederland N.V. EO-Bonds 23(23/28) XS2694995163	EUR	315	315	0	100,336 %	316.058,09	0,15
2,8750 % AT & T Inc. EO-FLR Pref.Secs 20(25/Und.) XS2114413565	EUR	1.000	0	0	97,375 %	973.750,00	0,45
1,1250 % Australia & N. Z. Bkg Grp Ltd. EO-FLR Med.-Term Nts 19(24/29) XS2082818951	EUR	1.000	1.000	0	97,704 %	977.040,00	0,45
2,3750 % Barry Callebaut Services N.V. EO-Notes 16(24) BE6286963051	EUR	1.000	1.000	0	99,739 %	997.390,00	0,46
0,1000 % Booking Holdings Inc. EO-Nts 21(21/25) XS2308321962	EUR	1.000	0	0	96,725 %	967.250,00	0,45
Bundesrep.Deutschland Unv.Schatz.A.23/07 f.19.06.24 DE000BU0E063	EUR	3.000	0	0	99,218 %	2.976.540,00	1,37
3,8750 % Daimler Truck Intl Finance EO-Med.-Term Notes 23(23/26) XS2623129256	EUR	400	0	0	100,941 %	403.763,20	0,19
0,9500 % Deutsche Bahn Finance GmbH Sub.-FLR-Nts.v.19(25/unb.) XS2010039035	EUR	1.500	1.500	0	96,483 %	1.447.249,50	0,67
Frankreich EO-Treasury Bills 24(24) FR0128227701	EUR	4.000	4.000	0	99,928 %	3.997.120,00	1,84
Frankreich EO-Treasury Bills 24(24) FR0128227743	EUR	5.000	5.000	0	99,336 %	4.966.800,00	2,29
Frankreich EO-Treasury Bills 24(24) FR0128227768	EUR	5.000	5.000	0	98,822 %	4.941.100,00	2,28

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung ISIN	Markt	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 31.3.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)</b>								
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								
3,0000 % Linde PLC EO-Med.-Term Nts 24(24/28) XS2765559799		EUR	1.000	1.000	0	99,608 %	996.083,00	0,46
4,1250 % LKQ Dutch Bond B.V. EO-Nts 24(24/31) XS2777367645		EUR	590	590	0	101,526 %	599.001,63	0,28
3,6250 % McDonald's Corp. EO-Med.-T. Nts 23(23/27) XS2726262863		EUR	590	590	0	101,050 %	596.195,59	0,28
0,2500 % Santander Consumer Bank AG EO Med.-Term Notes 19(24) XS2063659945		EUR	1.000	0	0	98,053 %	980.530,00	0,45
4,2500 % Sartorius Finance B.V. EO-Nts 23(23/26) XS2678111050		EUR	300	0	0	101,152 %	303.456,60	0,14
4,6250 % Telia Company AB EO-FLR Nts 22(22/82) XS2526881532		EUR	1.000	1.000	0	101,096 %	1.010.964,00	0,47
3,0000 % Transurban Finance Co. Pty Ltd EO-Med.-Term Nts 20(20/30) XS2152883406		EUR	1.000	0	0	97,339 %	973.388,00	0,45
2,1250 % Volvo Car AB EO-Med.-T. Nts 19(19/24) XS1971935223		EUR	703	703	0	99,900 %	702.297,00	0,32
Summe Wertpapiervermögen							210.375.822,73	97,06
<b>Derivate</b> (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)							<b>-17.500,00</b>	<b>-0,01</b>
<b>Zins-Derivate</b> Forderungen/Verbindlichkeiten							<b>-17.500,00</b>	<b>-0,01</b>
<b>Zinsterminkontrakte</b> FUTURE EURO-SCHATZ 06.06.24 EUREX							<b>-17.500,00</b>	<b>-0,01</b>
	185	EUR	50.000.000			-17.500,00	-0,01	

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 31. März 2024

Gattungsbezeichnung	Bestand 31.3.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
BANKGUTHABEN, NICHT VERBRIEFTE GELDMARKTINSTRUMENTE UND GELDMARKTFONDS					4.253.057,69	1,96
<b>Bankguthaben</b>					<b>4.253.057,69</b>	<b>1,96</b>
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen bei:</b>						
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			NOK	343.248,84	29.296,19	0,01
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:</b>						
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			GBP	3.938,76	4.607,01	0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			USD	4.556.686,85	4.219.154,49	1,95
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>					<b>2.291.682,25</b>	<b>1,06</b>
Zinsansprüche					1.954.028,25	0,90
Einschüsse (Initial Margins)					337.654,00	0,16
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>					<b>-69.856,10</b>	<b>-0,03</b>
EUR-Kredite					-69.856,10	-0,03
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>					<b>-80.698,28</b>	<b>-0,04</b>
Zinsverbindlichkeiten					-614,75	0,00
Verwaltungsvergütung					-64.867,88	-0,03
Verwahrstellenvergütung					-4.094,70	0,00
Prüfungskosten					-4.426,23	0,00
Veröffentlichungskosten					-6.694,72	0,00
Fondsvermögen					216.752.508,29	100,00 <sup>1)</sup>

Anteilwert	EUR	144,60
Ausgabepreis	EUR	144,60
Anteile im Umlauf	Stück	1.499.031

## WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)						
Britisches Pfund	GBP	1 EUR =	0,8549500	US-Dollar	USD	1 EUR = 1,0800000
Norwegische Krone	NOK	1 EUR =	11,7165000			

## Marktschlüssel

Terminbörsen

185 = Eurex Deutschland

<sup>1)</sup> Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE</b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
3,8750 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Medium-Term Notes 24(32)	XS2747610751	EUR	400	400
3,3750 % Allianz SE FLR-Med.Ter.Nts.v.14(24/unb.)	DE000A13R7Z7	EUR	2.000	2.000
4,0000 % Booking Holdings Inc. EO-Notes 22(22/26)	XS2555218291	EUR	0	1.000
0,1000 % Bundesrep.Deutschland Inflationsindex. Anl.v.21(33)	DE0001030583	EUR	3.000	3.000
5,1250 % Commerzbank AG Med.Term-FLN v.23(29/30)	DE000CZ43ZN8	EUR	0	500
2,7500 % Deutsche Post AG Medium Term Notes v.13(23)	XS0977496636	EUR	0	1.000
3,8750 % EDP - Energias de Portugal SA EO-Med.-Term Nts 23(23/28)	PTEDPUOM0008	EUR	0	300
0,5000 % Finnland, Republik EO-Bonds 19(29)	FI4000369467	EUR	0	3.000
0,2500 % Fresenius Medical Care KGaA MTN v.19(23/23)	XS2084510069	EUR	0	1.000
3,8750 % Iren S.p.A. EO-Medium-Term Nts 24(24/32)	XS2752472436	EUR	475	475
3,2500 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 24(32)	DE000A3LSYH6	EUR	751	751
4,3750 % NN Group N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 14(24/Und.)	XS1076781589	EUR	1.000	1.000
4,5000 % Schaeffler AG MTN v.24(24/26)	DE000A3823R3	EUR	1.000	1.000
2,7500 % Spanien EO-Bonos 14(24)	ES00000126B2	EUR	1.000	5.000
4,3750 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 19(25/Und.)	XS1933828433	EUR	0	800
1,1250 % Teva Pharmac.Fin.NL II B.V. EO-Notes 16(16/24)	XS1439749281	EUR	0	500
5,3750 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Med.-Term Nts 24(29/34)	IT0005580102	EUR	1.000	1.000
3,2500 % Verizon Communications Inc. EO-Notes 14(14/26)	XS1030900242	EUR	0	1.000
6,5000 % Vodafone Group PLC EO-FLR Med.-T. Nts 23(23/84)	XS2630490717	EUR	1.000	1.000
2,2500 % Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 15(16/23)	DE000A18V146	EUR	0	1.000
3,7500 % Wolters Kluwer N.V. EO-Notes 23(23/31)	XS2592516210	EUR	0	259
1,5000 % European Investment Bank NK-Medium-Term Notes 17(24)	XS1555330999	NOK	0	20.000
1,2500 % Kreditanst.f.Wiederaufbau DL-Anl.v.22 (25)	US500769JR67	USD	0	1.000
4,6250 % Kreditanst.f.Wiederaufbau DL-Anl.v.23 (26)	US500769JZ83	USD	0	2.000

### AN ORGANISIERTEN MÄRKTEN ZUGELASSENE ODER IN DIESE EINBEZOGENE WERTPAPIERE

<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
3,8750 % Amprion GmbH MTN v. 23(28/28)	DE000A3514E6	EUR	0	800
4,3750 % Carrier Global Corp. EO-Notes 23(23/25) Reg.S	XS2723569559	EUR	981	981
0,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-Non-Preferred MTN 19(24)	XS1956955980	EUR	0	1.000
0,0050 % Merck Financial Services GmbH MTN v. 19(19/23)	XS2023643146	EUR	0	1.000
1,0000 % UBS Group AG EO-FLR Med.Trm.Nts.22(24/25)	CH1168499791	EUR	0	1.000

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (Fortsetzung)</b>				
<b>NICHTNOTIERTE WERTPAPIERE <sup>2)</sup></b>				
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				
4,7500 % Allianz SE FLR-Med.Ter.Nts.v.13(23/unb.)	DE000A1YCQ29	EUR	0	1.800
4,2500 % Aquarius & Investments PLC EO-FLR M.-T. LPN13(23/43)Zürich	XS0897406814	EUR	0	2.000
2,5750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-FLR Med.-T.Nts 19(24/29)	XS1954087695	EUR	800	1.500
0,1000 % Banco Santander S.A. EO-FLR Preferred MTN 22(24/25)	XS2436160779	EUR	0	1.000
0,8750 % BPCE S.A. EO-Non-Preferred MTN 18(24)	FR0013312493	EUR	0	1.500
4,2500 % CA Auto Bank S.p.A. EO-Med.-Term Notes 22(24)	XS2549047244	EUR	0	654
0,2500 % Deutsche Bank AG MTN-HPF v.16(24)	DE000DL19SH3	EUR	2.000	2.000
0,1250 % Diageo Finance PLC EO-Medium-Term Nts 19(23/23)	XS1982107903	EUR	0	1.000
2,7500 % Elia Group EO-FLR Nts 18(23/Und.)	BE0002597756	EUR	0	1.000
Frankreich EO-Treasury Bills 23(24)	FR0127921296	EUR	0	3.000
4,9560 % Goldman Sachs Group Inc., The EO-FLR Med.-T. Nts 22(24/25)	XS2441551970	EUR	0	1.000
5,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Med.-T. Nts 19(24/29)	XS1958656552	EUR	1.000	1.000
0,5000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Med.-Term Hyp.-Pfdbr.19(24)	IT0005365231	EUR	0	2.500
4,5000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 13(24)	IT0004953417	EUR	5.000	5.000
0,6500 % Italien, Republik EO-B.T.P. 16(23)	IT0005215246	EUR	0	3.000
0,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 22(23)	IT0005482309	EUR	3.000	4.000
0,6250 % JPMorgan Chase & Co. EO-Medium-Term Nts 16(23/24)	XS1456422135	EUR	0	1.500
5,6250 % SES S.A. EO-FLR Notes 16(24/Und.)	XS1405765659	EUR	0	500
1,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-FLR Med.-T. Nts 16(23/28)	XS1511589605	EUR	0	1.500
0,6250 % Sparebank 1 SR-Bank ASA EO-Preferred Med.-T.Nts 19(24)	XS1967582831	EUR	0	2.000
3,9980 % Thermo Fisher Scient.(Fin.I)BV EO-FLR Notes 21(23)	XS2407911705	EUR	0	1.000
4,8750 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Med.-T. Nts 19(24/29)	XS1953271225	EUR	500	1.000
<b>INVESTMENTANTEILE</b>				
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>				
Xtrackers DAX Inhaber-Anteile 1C o.N.	LU0274211480	ANT	24.900	24.900

<sup>3)</sup> Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

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

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Volumen in 1.000
<b>BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (Fortsetzung)</b>					
<b>DERIVATE</b> (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)					
<b>TERMINKONTRAKTE</b>					
<b>Zinsterminkontrakte</b>					
gekaufte Kontrakte:					
(Basiswert[e]:	10Y.US TRE.INT.SYN.AN., 8,5-10Y.ITA.GOV.BD.SYN.AN, EURO-SCHATZ)		EUR		122.152,12
verkaufte Kontrakte:					
(Basiswert[e]:	EURO-BOBL, EURO-BUND)		EUR		533.036,89
<b>Devisenterminkontrakte (Verkauf)</b>					
Verkauf von Devisen auf Termin:					
NOK/EUR			EUR		1.707

Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 54,72%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 850.912.142,81 EUR.

# Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>97,06</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>-0,01</b>

## Sonstige Angaben

Anteilwert	EUR	144,60
Ausgabepreis	EUR	144,60
Anteile im Umlauf	Stück	1.499.031

## 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 Vielfältigkeit 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 hinzuge-rechnet.

**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.

Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

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.

**Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 - Ausweis nach Abschnitt A**

Im Berichtszeitraum lagen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps gemäß der oben genannten rechtlichen Bestimmung vor.

## Kurzübersicht über die Partner des Basis-Fonds I Nachhaltig

### ODDO BHF Asset Management GmbH

Herzogstraße 15  
40217 Düsseldorf  
Postanschrift:  
Postfach 10 53 54, 40044 Düsseldorf  
Telefon: +49 (0) 211 239 24-01

Zweigstelle Frankfurt am Main  
Gallusanlage 8  
60329 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

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

### GESCHÄFTSFÜHRUNG

#### Nicolas Chaput

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

#### Dr. Stefan Steurer

#### Bastian Hoffmann

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

### VERTRIEB UND INITIATOR

MLP Banking AG  
Alte Heerstraße 40  
69168 Wiesloch

Alle Angaben Stand Januar 2024

## **ODDO BHF Asset Management GmbH**

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

Zweigstelle Frankfurt am Main  
Gallusanlage 8  
60329 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](http://am.oddo-bhf.com)**



**ODDO BHF**  
ASSET MANAGEMENT