



Composition de l'actif

au 30 septembre 2024

LBPAM ISR STRATEGIE PEA 2

Part **R**, Part **S**

FORME JURIDIQUE DE L'OPC

FCP de droit français

CLASSIFICATION

N/A

Document public

LBP AM – 36, Quai Henri IV – 75004 Paris

LBP AM est une société de gestion agréée auprès de l'AMF sous le n° GP-20000031 SA à Directoire et Conseil de Surveillance au capital de 12 138 931,20 euros – 879 553 857 RCS Paris

lbpam.com

Inventaire des actifs et passifs

INVENTAIRE DES ÉLÉMENTS DE BILAN

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ACTIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			36 653 291,07	90,00
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			36 653 291,07	90,00
Assurance			2 834 376,42	6,96
AEGON NV	EUR	31 782	183 318,58	0,45
ALLIANZ SE-REG	EUR	3 136	925 120,00	2,26
ASR NEDERLAND NV	EUR	2 922	128 568,00	0,32
ASSICURAZIONI GENERALI	EUR	8 554	221 976,30	0,55
AXA	EUR	16 048	554 137,44	1,36
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG AG	EUR	1 472	727 609,60	1,79
SAMPO PLC	EUR	2 235	93 646,50	0,23
Automobiles			253 346,71	0,62
RENAULT SA	EUR	3 211	125 196,89	0,31
STELLANTIS NV	EUR	10 328	128 149,82	0,31
Banques commerciales			3 498 726,52	8,62
BANCO DE BILBAO VIZCAYA S.A.	EUR	39 269	381 223,45	0,94
BANCO DE SABADELL S.A.	EUR	32 718	62 458,66	0,15
BANKINTER SA	EUR	8 454	67 023,31	0,16
BANK OF IRELAND GROUP PLC	EUR	7 631	76 538,93	0,19
BNP PARIBAS	EUR	8 915	548 718,25	1,35
CAIXABANK S.A.	EUR	21 648	116 119,87	0,29
COMMERZBANK AG	EUR	11 247	185 856,68	0,46
CREDIT AGRICOLE	EUR	6 072	83 338,20	0,20
ERSTE GROUP BANK	EUR	3 126	153 955,50	0,38
ING GROEP NV	EUR	26 622	433 246,43	1,06
INTESA SANPAOLO	EUR	132 679	509 155,66	1,25
KBC GROUPE	EUR	2 183	155 909,86	0,38
SOCIETE GENERALE SA	EUR	6 589	147 264,15	0,36
UNICREDIT SPA	EUR	14 681	577 917,57	1,45
Biens de consommation durables			57 810,00	0,14
SEB	EUR	564	57 810,00	0,14
Biotechnologie			95 573,08	0,23
GRIFOLS SA SHARES A	EUR	9 347	95 573,08	0,23
Boissons			224 530,52	0,55
HEINEKEN	EUR	2 008	159 917,12	0,39
HEINEKEN HOLDING NEW	EUR	953	64 613,40	0,16
Compagnies aériennes			58 246,16	0,14
DEUTSCHE LUFTHANSA NOMINATIVE	EUR	8 852	58 246,16	0,14
Composants automobiles			323 230,34	0,79
FORVIA	EUR	2 258	20 836,82	0,05
MICHELIN (CGDE)	EUR	6 794	247 709,24	0,61
VALEO	EUR	5 054	54 684,28	0,13
Conglomérats industriels			1 334 095,02	3,28
ROYAL PHILIPS	EUR	6 613	194 554,46	0,48

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SIEMENS AG-REG	EUR	6 284	1 139 540,56	2,80
Construction et ingénierie			191 868,00	0,47
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	EUR	1 685	69 893,80	0,17
ARCADIS NV	EUR	1 961	121 974,20	0,30
Courrier, fret aérien et logistique			338 253,50	0,83
DEUTSCHE POST AG NAMEN	EUR	8 450	338 253,50	0,83
Distribution de produits alimentaires de première nécessité			412 497,50	1,01
CARREFOUR	EUR	9 126	139 719,06	0,33
JERONIMO MARTINS	EUR	5 196	91 657,44	0,23
KESKO OYJ B	EUR	6 343	121 563,60	0,30
NN GROUP NV	EUR	1 330	59 557,40	0,15
Distribution spécialisée			664 242,92	1,63
INDITEX	EUR	9 739	517 530,46	1,27
MONCLER SPA	EUR	2 573	146 712,46	0,36
Divertissement			103 063,02	0,25
VIVENDI	EUR	9 929	103 063,02	0,25
Electricité			2 007 346,35	4,93
ELEC DE PORTUGAL	EUR	38 227	156 807,15	0,39
ENDESA SA	EUR	2 807	55 101,41	0,14
ENEL SPA	EUR	71 296	511 548,80	1,26
IBERDROLA SA	EUR	48 932	679 665,48	1,65
LEGRAND SA	EUR	3 766	389 027,80	0,96
RED ELECTRICA DE ESPANA	EUR	5 174	90 389,78	0,22
TERNA	EUR	15 431	124 805,93	0,31
Equipements de communication			121 636,15	0,30
NOKIA (AB) OYJ	EUR	30 998	121 636,15	0,30
Equipements électriques			265 237,49	0,65
ALSTOM	EUR	4 951	92 261,89	0,23
PRYSMIAN SPA	EUR	2 653	172 975,60	0,42
Equipements et fournitures médicaux			682 011,80	1,67
BIOMERIEUX	EUR	1 792	192 819,20	0,47
ESSILORLUXOTTICA	EUR	2 301	489 192,60	1,20
FPI Bureautiques			95 748,40	0,24
GECINA SA	EUR	926	95 748,40	0,24
FPI de détail			244 141,36	0,60
KLEPIERRE	EUR	4 774	140 546,56	0,35
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	EUR	1 318	103 594,80	0,25
Gestion immobilière et développement			156 809,43	0,39
VONOVIA SE	EUR	4 791	156 809,43	0,39
Grands magasins et autres			569 819,64	1,40
PROSUS NV	EUR	14 514	569 819,64	1,40
Hôtels, restaurants et loisirs			517 854,33	1,27
ACCOR SA	EUR	6 372	248 508,00	0,60
AMADEUS IT GROUP SA	EUR	2 859	185 606,28	0,46
SODEXO / EX SODEXHO ALLIANCE	EUR	1 137	83 740,05	0,21
Industrie aérospatiale et défense			1 003 761,00	2,46
AIRBUS SE	EUR	3 190	418 591,80	1,03

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SAFRAN SA	EUR	2 772	585 169,20	1,43
Infrastructure de transports			66 528,10	0,16
AEROPORTS DE PARIS	EUR	577	66 528,10	0,16
Logiciels			2 764 193,42	6,79
AENA SME SA	EUR	582	115 003,20	0,28
BOUYGUES	EUR	3 265	98 145,90	0,24
DASSAULT SYST.	EUR	4 893	174 337,59	0,43
EVONIK INDUSTRIES AG	EUR	5 922	124 362,00	0,31
NEXI SPA	EUR	8 352	50 880,38	0,12
SAP SE	EUR	9 096	1 859 222,40	4,57
VINCI SA	EUR	3 261	342 241,95	0,84
Machines			355 997,92	0,87
SIEMENS ENERGY AG	EUR	4 456	147 359,92	0,36
WAERTSILAE CORPORATION	EUR	10 380	208 638,00	0,51
Marches de capitaux			1 325 417,48	3,25
ABN AMRO BANK NV-CVA	EUR	7 831	126 901,36	0,31
AIB GROUP PLC	EUR	16 282	83 770,89	0,21
BANCO SANTANDER S.A.	EUR	129 318	594 927,46	1,45
FINECOBANK SPA	EUR	5 227	80 365,13	0,20
MEDIOBANCA SPA	EUR	9 863	151 150,48	0,37
NORDEA BANK ABP	EUR	27 224	288 302,16	0,71
Matériaux de construction			140 251,20	0,34
HEIDELBERGER ZEMENT	EUR	1 437	140 251,20	0,34
Media			269 755,40	0,66
PUBLICIS GROUPE SA	EUR	2 747	269 755,40	0,66
Métaux et minerais			80 402,85	0,20
AURUBIS AG	EUR	1 221	80 402,85	0,20
Outils et services appliqués aux sciences biologiques			191 199,72	0,47
EUROFINS SCIENTIFIC	EUR	2 154	122 562,60	0,30
QIAGEN N.V.	EUR	1 696	68 637,12	0,17
Papier et industrie du bois			140 444,13	0,34
STORA ENSO AB EX ENSO OYJ	EUR	9 182	105 593,00	0,25
UPM-KYMMENE OYJ	EUR	1 159	34 851,13	0,09
Pétrole et gaz			1 181 597,48	2,90
ENI SPA	EUR	19 040	260 505,28	0,64
GALP ENERGIA SGPS SA	EUR	7 612	127 881,60	0,31
NESTE OYJ	EUR	597	10 405,71	0,03
OMV AG	EUR	1 806	69 278,16	0,17
REPSOL SA	EUR	16 234	192 291,73	0,47
TOTALENERGIES SE	EUR	8 910	521 235,00	1,28
Producteur et commerce d'énergie indépendants			131 765,76	0,32
RWE AG	EUR	4 032	131 765,76	0,32
Produits alimentaires			463 391,28	1,14
DANONE	EUR	7 092	463 391,28	1,14
Produits chimiques			815 327,39	2,00
AKZO NOBEL	EUR	1 859	117 674,70	0,29
ARKEMA	EUR	746	63 783,00	0,16

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BASF SE	EUR	1 523	72 426,27	0,18
DSM-FIRMENICH AG	EUR	1 510	186 711,50	0,46
SYENSQO SA	EUR	1 496	119 096,56	0,29
SYMRISE AG	EUR	1 715	212 831,50	0,51
UMICORE	EUR	3 671	42 803,86	0,11
Produits de soins personnels			940 394,95	2,31
L'OREAL	EUR	2 339	940 394,95	2,31
Produits domestiques			329 413,20	0,81
HENKEL AG AND CO.KGAA NON VTG PRF	EUR	3 903	329 413,20	0,81
Produits pharmaceutiques			1 547 551,82	3,80
COVESTRO AG	EUR	2 291	128 158,54	0,31
MERCK KGA	EUR	1 476	233 208,00	0,57
ORION CORPORATION	EUR	3 689	181 572,58	0,45
SANOFI	EUR	9 763	1 004 612,70	2,47
Produits pour l'industrie du bâtiment			434 105,52	1,07
KINGSPAN GROUP PLC	EUR	1 992	168 025,20	0,41
SAINT-GOBAIN	EUR	3 256	266 080,32	0,66
Semi-conducteurs et équipements pour fabrication			3 018 876,98	7,41
ASM INTERNATIONAL NV	EUR	270	159 138,00	0,39
ASML HOLDING NV	EUR	3 101	2 312 105,60	5,67
INFINEON TECHNOLOGIES	EUR	11 589	364 589,94	0,90
STMICROELECTRONICS NV	EUR	6 871	183 043,44	0,45
Services aux collectivités			802 989,74	1,97
E.ON AG NOM.	EUR	11 720	156 520,60	0,38
ENGIE	EUR	11 748	182 270,22	0,45
HERA SPA	EUR	24 516	87 816,31	0,22
POSTE ITALIANE	EUR	14 031	176 650,29	0,43
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	6 766	199 732,32	0,49
Services aux professionnels			720 452,26	1,77
BUREAU VERITAS SA	EUR	8 847	263 463,66	0,65
RANDSTAD N.V.	EUR	1 203	53 653,80	0,13
SR TELEPERFORMANCE	EUR	504	46 872,00	0,12
WOLTERS KLUWER	EUR	2 356	356 462,80	0,87
Services clientèle divers			87 873,66	0,22
EDENRED	EUR	2 583	87 873,66	0,22
Services de télécommunication diversifiés			1 403 515,08	3,45
CELLNEX TELECOM SA	EUR	3 567	129 945,81	0,32
DEUTSCHE TELEKOM AG	EUR	30 534	805 792,26	1,98
KONINKLIJKE KPN NV	EUR	64 142	235 337,00	0,58
ORANGE	EUR	3 603	37 056,86	0,09
TELECOM ITALIA ORD SPA	EUR	170 936	42 648,53	0,10
TELEFONICA SA	EUR	34 744	152 734,62	0,38
Services financiers diversifiés			607 122,10	1,49
AMUNDI	EUR	1 478	99 099,90	0,24
DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	1 219	256 843,30	0,63
EURAZEO	EUR	1 011	74 561,25	0,18
EURONEXT NV - W/I	EUR	617	60 126,65	0,15

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SMURFIT WESTROCK PLC	GBP	2 593	116 491,00	0,29
Services liés aux technologies de l'information			410 451,85	1,01
ALTEN SA	EUR	352	35 235,20	0,09
CAPGEMINI SE	EUR	1 279	248 062,05	0,61
THALES	EUR	892	127 154,60	0,31
Sociétés commerciales et de distribution			112 735,77	0,28
REXEL	EUR	4 341	112 735,77	0,28
Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC)			53 895,40	0,13
COVIVIO	EUR	988	53 895,40	0,13
Soins et autres services médicaux			58 330,60	0,14
AMPLIFON	EUR	2 260	58 330,60	0,14
Textiles, habillement et produits de luxe			2 145 084,35	5,27
CHRISTIAN DIOR SE	EUR	134	86 899,00	0,21
HERMES INTERNATIONAL	EUR	261	575 766,00	1,41
HUGO BOSS NOM.	EUR	1 265	51 978,85	0,13
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	EUR	2 028	1 396 278,00	3,44
PUMA SE	EUR	911	34 162,50	0,08
TITRES D'OPC			741 929,77	1,82
OPCVM			741 929,77	1,82
Gestion collective			741 929,77	1,82
OSTRUM SRI CASH Part M	EUR	43	449 738,29	1,10
OSTRUM SRI CASH Z	EUR	28	292 191,48	0,72
TITRES FINANCIERS MIS EN DÉPOSIT			3 322 343,05	8,16
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			3 322 343,05	8,16
Automobiles			385 385,60	0,95
MERCEDES BENZ GROUP AG REGISTERED SHARES	EUR	6 640	385 385,60	0,95
Boissons			176 415,60	0,43
PERNOD RICARD	EUR	1 301	176 415,60	0,43
Équipements électriques			1 336 655,80	3,29
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	5 659	1 336 655,80	3,29
Pétrole et gaz			594 711,00	1,46
TOTALENERGIES SE	EUR	10 166	594 711,00	1,46
Producteur et commerce d'énergie indépendants			686 109,60	1,68
AIR LIQUIDE SA	EUR	3 960	686 109,60	1,68
Textiles, habillement et produits de luxe			143 065,45	0,35
KERING	EUR	557	143 065,45	0,35
CRÉANCES REPRÉSENTATIVES DE TITRES PRÊTÉS			193 446,00	0,48
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			193 446,00	0,48
Papier et industrie du bois			153 357,00	0,38
UPM-KYMMENE OYJ	EUR	5 100	153 357,00	0,38
Pétrole et gaz			40 089,00	0,10
NESTE OYJ	EUR	2 300	40 089,00	0,10
INDEMNITÉS SUR TITRES PRÊTÉS			167,67	0,00
Total			40 911 177,56	100,46

(*) Le secteur d'activité représente l'activité principale de l'émetteur de l'instrument financier ; il est issu de sources fiables reconnues au plan international (GICS et NACE principalement).

INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISES

Type d'opération	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)			
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
Total	0,00	0,00		0,00		0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

INVENTAIRE DES INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME

Inventaire des instruments financiers à terme - actions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
EURO STOXX 50 1224	-254	0,00	-404 321,00	-12 776 200,00
Sous-total 1.		0,00	-404 321,00	-12 776 200,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	-404 321,00	-12 776 200,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - taux d'intérêts

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - de change

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - sur risque de crédit

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - autres expositions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

INVENTAIRE DES INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME OU DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISES UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART

L'OPC sous revue n'est pas concerné par cette rubrique.

Synthèse de l'inventaire

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	40 911 177,56
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	0,00
Total instruments financiers à terme - actions	-404 321,00
Total instruments financiers à terme - taux	0,00
Total instruments financiers à terme - change	0,00
Total instruments financiers à terme - crédit	0,00
Total instruments financiers à terme - autres expositions	0,00
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	0,00
Autres actifs (+)	523 430,29
Autres passifs (-)	-305 462,86
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	40 724 823,99

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part LBPAM ISR STRATEGIE PEA 2 R	EUR	27 228,20708	1 224,43
Part LBPAM ISR STRATEGIE PEA 2 S	EUR	64 268,70170	114,91