



Composition de l'actif

au 30 juin 2025

LBPAM 90 HORIZON JUILLET 2028

FORME JURIDIQUE DE L'OPC

FCP de droit français

CLASSIFICATION

Garanti ou assorti d'une protection

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
TITRES D'OPC			116 775 007,24	99,89
OPCVM			110 360 745,66	94,40
Gestion collective			110 360 745,66	94,40
Echiquier Altarocca Hybrid Bonds F	EUR	1 800,429	2 107 978,28	1,80
ECQUER CRDT SRI EUROPE-IXL	EUR	6 427,228	6 908 691,65	5,91
FCP LBPAM ISR OBLI MOYEN TERME PART E SI.	EUR	21 041,36062	2 963 044,40	2,53
LBPAM Actions Indice Euro I	EUR	38,53	1 122 312,70	0,96
LBPAM DETTES FINANCIERES FLEXIBLE Part I	EUR	127,65	1 485 792,74	1,27
LBPAM INFLATION FLEXIBLE Part I	EUR	72,25	855 389,66	0,73
LBPAM ISR Actions Asie M	EUR	144,17	1 962 434,99	1,68
LBPAM ISR ACTIONS EMERGENTS M	EUR	192,39	2 479 457,28	2,12
LBPAM ISR ACTIONS JAPON R	EUR	384,95	891 770,91	0,76
LBPAM ISR CONVERTIBLES EUROPE I	EUR	224,66	3 666 719,59	3,14
LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES I	EUR	265,49	3 681 737,44	3,15
LBPAM ISR OBLI EUROPE D	EUR	34 126,71131	3 950 849,37	3,38
LBPAM ISR OBLI LONG TERME M FCP 5DEC	EUR	348,59	6 661 034,57	5,70
OSTRUM SRI CASH Part M	EUR	1 972,06866	21 060 884,74	18,02
OSTRUM SRI CASH PLUS I	EUR	378,66	41 634 701,19	35,61
OSTRUM SRI CROSSOVER I	EUR	174,38	2 332 280,85	2,00
OSTRUM SRI MONEY 6M PART I	EUR	477,85	5 394 028,56	4,61
TOCQUEVILLE EURO EQUITY ISR I	EUR	41,11	1 201 636,74	1,03
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne			6 414 261,58	5,49
Gestion collective			6 414 261,58	5,49
LBPAM ISR Actions USA 500 R	EUR	28 141,36614	6 414 261,58	5,49
Total			116 775 007,24	99,89

(*) 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				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
SWAP MN4 UBS	1	0,00	-72 926,73	1,00
Sous-total 3.		0,00	-72 926,73	1,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	-72 926,73	1,00

(*) 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)	116 775 007,24
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	-72 926,73
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 (+)	249 076,55
Autres passifs (-)	-53 219,66
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	116 897 937,40

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part LBPAM 90 HORIZON JUILLET 2028	EUR	1 075 968,70630	108,64

Stock : Stock admi principal au 30/06/25
PORTEFEUILLE : 000M4 LBPAM 90 HORIZON JUILLET 2028

VL VALDEE

Devise de Fixing : FRX Devises Reuters
Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifié, trame : PC3 TRI AMF/TYRE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

V A L E U R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COUS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PROX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille			-----> PLUS OU MOINS VAL	PCT ACT NET
										VALEUR	BOURSIERE	COURU TOTA		

III - TITRES D OPC

OPCVM ET EQUIVALENTS D AUTRES ETATS MEMBRE DE L UE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR001400N306	EQ	CDOT	SRI-DXL		P	EUR	6,427.228		1057.3852	M	30/06/25	1074.91	0	6,796,055.89	6,908,691.65	0.00	112,635.76	5.91
FR0013218005	Echiquier	Altarocca			P	EUR	1,800.429		1144.4425	M	30/06/25	1170.82	0	2,060,487.40	2,107,978.28	0.00	47,490.88	1.80
FR0010613356	FCP	LBPAM	IS OB MT E		P	EUR	21,041.36062		138.5347	M	30/06/25	140.82	5	2,914,959.46	2,963,044.40	0.00	48,084.94	2.53
FR0013398658	LB	Def	Fin Flex I		P	EUR	127.65354		10975.7291	M	30/06/25	11639.26	5	1,401,090.67	1,485,792.74	0.00	84,702.07	1.27
FR0013323102	LBPAM	I A AST-MEUR			P	EUR	144.17213		12709.182	M	30/06/25	13611.75	5	1,832,309.84	1,962,434.99	0.00	130,125.15	1.68
FR0013358025	LBPAM	INFLAT.FLEX.I			P	EUR	72.25478		11491.3391	M	30/06/25	11838.52	5	830,304.18	855,389.66	0.00	25,085.48	0.73
FR0000994493	LBPAM	IS OB LT -M-5D			P	EUR	348.58685		18846.9011	M	30/06/25	19108.68	5	6,569,781.87	6,661,034.57	0.00	91,252.70	5.70
FR0010892471	LBPAM	ISR ACT JAP R			P	EUR	384.95481		2162.2414	M	30/06/25	2316.56	5	832,365.21	891,770.91	0.00	59,405.70	0.76
FR0013330271	LBPAM	ISR ACT BME M			P	EUR	192.39406		11960.2642	M	30/06/25	12887.39	5	2,301,083.78	2,479,457.28	0.00	178,373.50	2.12
FR0010914069	LBPAM	ISR AET I			P	EUR	38.52618		25645.4953	M	30/06/25	29131.17	5	988,022.97	1,122,312.70	0.00	134,289.73	0.96
FR0010470609	LBPAM	ISR CONV EUR I			P	EUR	224.66323		15588.608	M	30/06/25	16320.96	5	3,502,187.02	3,666,719.59	0.00	164,532.57	3.14
FR0011640903	LBPAM	ISR CONV OP I			P	EUR	265.49051		12713.8273	M	30/06/25	13867.68	5	3,899,297.31	3,681,737.44	0.00	51,552.06	3.38
FR0000423360	LBPAM	ISR OBLI EUR D			P	EUR	34.126.71131		114.2594	M	30/06/25	115.77	5	3,375,400.49	3,950,849.37	0.00	306,336.95	3.15
FR0010392951	OSTRUM	SRI CASH M			P	EUR	1,972.06866		10605.4585	M	30/06/25	10679.59	5	20,914,692.24	21,060,884.74	0.00	146,192.50	18.02
FR0010831693	OSTRUM	SRI CAS PLU I			P	EUR	378.6578		100912.2774	M	30/06/25	109953.37	5	38,211,220.94	41,634,701.19	0.00	3,423,480.25	35.62
FR001135067	OSTRUM	SRI CROSSO I			P	EUR	174.37679		12800.869	M	30/06/25	13374.95	5	2,232,174.45	2,332,280.85	0.00	100,106.40	2.00
FR0010750984	OSTRUM	SRI MON 6M I			P	EUR	477.84792		10463.58	M	30/06/25	11288.17	5	4,999,999.94	5,394,028.56	0.00	394,028.62	4.61
FR0010842385	TOCQ	EUR	EQTY ISR I		P	EUR	41.1129		26136.6262	M	30/06/25	29227.73	5	1,074,552.50	1,201,636.74	0.00	127,084.24	1.03

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CMLL (EUR)

104,735,986.16

0.00

5,624,759.50

94.41

FIA ET EQUIVALENTS D AUTRES ETATS MEMBRE DE L UE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0013239407

LBPAM

ISR

AUSAS00 R

28,141,36614

P

EUR

235.2498

M

30/06/25

227.93

5

6,620,250.24

6,414,261.58

0.00

-205,988.66

5.49

III - TITRES D OPC

CMLL (EUR)

111,356,236.40

0.00

5,418,770.84

99.89

VII - AUTRES ENGAGEMENTS

SWAPS

AUTRES SWAPS

DATE ECHÉANCE : 04/07/28

FSM0364485

SWAP

MNA

 UBS |

PRC

1.

EUR

0.

30/06/25

-72,926.72

8445

M

0.00

-72,926.73

0.00

-72,926.73

-0.06

IX - TRESORERIE

DETTES ET CREANCES

CACEIS
OLISFA le 02/07/25 23:13:12

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admin principal au 30/06/25
Devise de fixing : FRF Devises Reuters
Portefeuille : 000M4 LBPAM 90 HORIZON JUILLET 2028
Devise du portefeuille : EUR
(Etat simplifié, trame : PC3 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R		STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PROX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSEIERE	Coupon COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
COLLATERAL CASH SUR PRETEMPRUNT														
DEVISE VALEUR : EUR EURO				50,000.	EUR	1.	30/06/25	1.		50,000.00	50,080.95	80.95	80.95	0.04
573BE4809+00 COLCASH738E4809UBS														
FRAIS DE GESTION														
DEVISE VALEUR : EUR EURO														
FGAMEEUR	Prov cotisation AMF			-552.89	EUR	1.	30/06/25	1.		-552.89	-552.89	0.00	0.00	0.00
FORPEEUR	Frais gest rétro in			12,578.13	EUR	1.	30/06/25	1.		12,578.13	12,578.13	0.00	0.00	0.01
FGPVFCEUR	Frais de Gest. Fixe			-52,666.77	EUR	1.	30/06/25	1.		-52,666.77	-52,666.77	0.00	0.00	-0.05
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO										-40,641.53	-40,641.53	0.00	0.00	-0.03
CUMUL (EUR)														
DETTES ET CREANCES														
CUMUL (EUR)										9,358.47	9,439.42	80.95	80.95	0.01
DISPONIBILITES														
AVOIRS														
DEVISE VALEUR : EUR EURO														
BQCEUR	CACEIS Bank			186,417.47	EUR	1.	30/06/25	1.		186,417.47	186,417.47	0.00	0.00	0.16
CUMUL (EUR)										195,775.94	195,856.89	80.95	80.95	0.17
IX - TRESORERIE														
PORTFEUILLE : LBPAM 90 HORIZON JUILLET 2028 (000M4)														
(EUR)										111,552,012.34	116,897,937.40	80.95	5,345,925.06	100.00

Portefeuille titres :		116,702,080.51	
<u>Frais de gestion du jour</u>			
Prov cotisation AMF :		9.03	EUR
Frais gest rétro in :		-1,265.79	EUR
Frais de Gest. Fixe :		5,092.43	EUR
<u>Frais de gestion charge Entreprise</u>			
Frais maximum notice :		19,216.73	EUR
Part	Devise	Actif net	Nombre de parts
CI FR00140083M3 LBPAM 90 HZ JUIL 28	EUR	116,897,937.40	1,075,968.7063
Actif net total en EUR :		116,897,937.40	
Precedente VL en date du 27/06/25 :			
CI	LBPAM 90 HZ JUIL 28	Prec. VL :	108.62 (EUR)
Variation :		+0.018%	
		Prix std Souscript.	111.35
		Prix std Rachat	108.64