

# Composition de l'actif

au 30 juin 2025

## LBPAM ISR PROTECT 80-85 MAI 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

# 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			146 125 564,74	99,80
OPCVM			121 101 826,32	82,71
Gestion collective			121 101 826,32	82,71
FEDERIS ISR ACTIONS US PART I	EUR	80,38	2 075 085,59	1,42
LBPAM Actions Indice Euro I	EUR	184,11	5 363 379,33	3,66
LBPAM ISR Actions Asie M	EUR	243,60	3 315 836,46	2,26
LBPAM ISR ACTIONS EMERGENTS M	EUR	420,41	5 418 046,01	3,70
LBPAM ISR Actions Ex-Euro I	EUR	3 107,48739	14 247 891,83	9,73
LBPAM ISR ACTIONS JAPON R	EUR	2 999,99683	6 949 672,66	4,75
LBPAM Tocqueville Croissance Euro ISR Part I	EUR	1 062,15385	6 146 408,17	4,20
OSTRUM SRI CASH Part M	EUR	670,21	7 157 543,13	4,89
OSTRUM SRI CASH PLUS I	EUR	535,63	58 894 543,48	40,22
TOCQUEVILLE EURO EQUITY ISR I	EUR	182,27	5 327 241,31	3,64
TOCQUEVILLE VALUE EURO ISR I	EUR	398,46	6 206 178,35	4,24
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne			25 023 738,42	17,09
Gestion collective			25 023 738,42	17,09
LBPAM ISR Actions USA 500 R	EUR	109 786,9452	25 023 738,42	17,09
Total			146 125 564,74	99,80

<sup>(\*)</sup> 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

	Valeur actuelle p	résentée au bilan	Montant de l'exposition (*)			
Type d'opération	A -4:5	Dece:f	Devis	ses à recevoir (+)	Devises à livrer (-)	
	Actif	Passif	Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
Total	0,00	0,00		0,00		0,00

<sup>(\*)</sup> 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 bil	Montant de l'exposition (*)	
	Nominal	Actif	Passif	+/-
1. Futures				
DJE 600 EUROP 0925	-42	0,00	-8 805,00	-1 139 460,00
EURO STOXX 50 0925	-33	0,00	-25 320,00	-1 757 910,00
MSCI EMG MKT 0925	-9	0,00	-19 678,83	-472 867,06
ONK TOKYO NIK 0925	-1	0,00	-15 570,01	-238 917,06
OSE TOPIX FUT 0925	-4	0,00	-18 990,69	-673 638,77
SP 500 MINI 0925	-9	0,00	-92 462,84	-2 397 399,58
Sous-total 1.		0,00	-180 827,37	-6 680 192,47
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	-180 827,37	-6 680 192,47

<sup>(\*)</sup> 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	Valeur actuelle bil	Montant de l'exposition (*)	
	Nominal	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 MNA BNP	1	0,00	-42 277,96	1,00
Sous-total 3.		0,00	-42 277,96	1,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	-42 277,96	1,00

<sup>(\*)</sup> 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	Valeur actuelle bil	Montant de l'exposition (*)	
	Nominal	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

<sup>(\*)</sup> 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	Valeur actuelle bil	Montant de l'exposition (*)	
	Nominal	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

<sup>(\*)</sup> 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	Valeur actuelle bil	Montant de l'exposition (*)	
	Nominal	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

<sup>(\*)</sup> 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)	146 125 564,74
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	-180 827,37
Total instruments financiers à terme - taux	-42 277,96
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 (+)	950 504,96
Autres passifs (-)	-427 893,10
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	146 425 071,27

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part LBPAM ISR PROTECT 80 85 MAI 2028	EUR	1346 508,29879	108,74

Stock: Stock admi principal au 30/06/25 PORTEFEUILLE: 000MNA LBPAM ISR PROTECT 80-85 MAI 2028

Inventaire sur historique de valorisation (HISIN)

≤ VALIDEE

Devise de fixing : Devise du portefeuille : FXR Devises Reuters
EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVALO4)

FR0013330271 LBPAM ISR ACT EME M FR0010914069 LBPAM ISR AFE I FR0011525534 LBPAM TO CR EUR-I FR0010392951 OSTRUM SRI CASH M FR0010831693 OSTRUM SRI CAS PLU I III - TITRES D OPC

OPCVM ET EQUIVALENTS D AUTRES ETATS MEMBRE DE L UE

DEVISE VALEUR: EUR EURO

80.3843: VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME ENGAGEMENTS A TERME FERMES SOUS-JACENT : SXXP FINL000008NP DJE 600 EUROP 0925 SOUS-JACENT: SPX FINL00000812 SP 500 MINI 0925 SOUS-JACENT: NKY TOKYO NIKKEI 225 AVERAGE FINLO000080M ONK TOKYO NIK 0925 FINLO000080H MSCI EMG MKT 0925 FR0013239407 LBPAM ISR AUSA500 R FR0010892471 LBPAM ISR ACT JAP R FR0013277522 FINLO000080F OSE TOPIX FUT 0925 FINL0000080E FIA ET EQUIVALENTS D AUTRES ETATS MEMBRE DE L UE Þ **FUTURES SUR INDICES** TOCQ EUR EQTY ISR I TOCQU VAL EUR ISR I EURO STOXX 50 0925 LBPAM I A X-E-I LBPAM I A ASI-MEUR FEDER ISR ACT US SOUS-JACENT : SX5E SOUS-JACENT : MXEF MSCI EMERGING MARKETS SOUS-JACENT : TPX \_ DEVISE VALEUR: EUR EURO SOUS TOTAL DEVISE VALEUR: EUR STATUTS VAL/LIGNE TOPIX INDEX (TOKYO) S&P 500 INDEX EURO STOXX 50 STOXX EUROPE 600 DOSSIER EURO QUANTITE ET EXPR. QUANTITE 109,786.9452 243.60104 3,107.48739 2,999.99683 420.41453 184.11136 1,062.15385 670.20767 535.632 182.26668 398.45517 -33. -42. -9. P EUR EUR Ę 9 2 **OSD** JΡY OSD ΣPY 26281.2642 12987.6345 4468.687 2288.6347 12163.9511 27994.2672 5745.5181 10628.4672 107398.6578 28304.3676 37870. Д.Р 2775. 5250 6012.5556 1182.1667 538 223.9847 EXPR. COURS R.U EN DEVISE 4071 2727 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 M 30/06/25 3 3 1 30/06/25 1 30/06/25 1 30/06/25 1 30/06/25 1 30/06/25 1 30/06/25 1 30/06/25 1 30/06/25 30/06/25 30/06/25 30/06/25 30/06/25 30/06/25 30/06/25 30/06/25 DATE CUMUL (EUR) CUMUL (EUR) 2316.56 12887.39 29131.17 5786.74 10679.59 109953.37 29227.73 15575.6 25814.56 13611.75 6253.75 2855.5 1233.5 4585.02 5327 542.6 COURS 227.93 PRIX REVIENT TOTA 2,112,601.29
3,163,801.28
13,886,388.63
6,865,896.85
5,113,901.78
5,154,062.61
6,102,624.14
7,123,280.22
57,526,157.87
5,158,943.11
5,745,766.07 142,544,021.69 117,953,423.85 24,590,597 0.0 0.00 0.0 0.00 0.00 0.00 .8 VALEUR BOURSIERE 2,075,085.59
3,315,836.46
14,247,891.83
6,949,672.66
5,418,046.01
5,363,379.33
6,146,408.17
7,157,443.13
58,894,543.48
5,327,241.31
6,206,178.35 146,125,564.74 121,101,826.32 25,023,738.42 Devise du portefeuille -92,462. -15,570.01 -19,678.83 -18,990.69 -25,320.00 -8,805.00 COUPON COURU TOTA 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 PLUS OU MOINS VAL -37, 515.70 152, 035.18 361, 503.20 83, 775.81 304, 144.23 209, 316.72 43, 784.03 34, 262.91 1, 368, 385.61 168, 298.20 460, 412.28 3,581,543.05 99. 3,148,402.47 -92 -15,570.01 -19,678.83 433,140.58 -18,990.69 -8,805.00 ,320.00 ,462.84 ACT NET -0.06 -0.01-0.0117.09 -0.01-0.0282.71 1.42 2.26 9.73 4.75 3.70 3.66 4.20 4.89 40.22 3.64 4.24

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/25 PORTEFEUILLE : 000MA LBPAM ISR PROTECT 80-85 MAI 2028

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXR Devises Reuters Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVALO4)

ş		FGPVFC1EUR Frais		FRAIS D		APPELS	<b>DE</b> MARCIUSD Appel	<b>DE</b> MARCIJPY Appel	APPELS DE MARCIEUR Appel	COLLATERAL CASH SU DEVISE VALEUR: 564BE4941+00 COLCASH564BE4941 BNP	IX - TRESORERIE  DETTES ET  COLLAT  DETTES ET  COLLAT  DETTES ET  DE  DE  DE  DE  DE  DE  DE  DE  DE	VII - AUTRES ENGAGEMENTS SWAPS SWAPS DE TAUX DATE ECHEANC PSW037491 SWAP MVA BNP	FUTURE	VALE
אסט וסואר טראוטר אאררטחי. רטח	SOUS TOTAL DEVISE VALEUR - FUR FURD	Frais de Gest. Fixe	Prov cotisation AMF	FRAIS DE GESTION DEVISE VALEUR: EUR EURO		APPELS DE MARGE	DEVISE VALEUR: USD DOLLARUS Appel Marge CACEIS	<b>DEVISE VALEUR: JPY YEN</b> Appel Marge CACEIS	APPELS DE MARGE  DEVISE VALEUR: EUR EURO Appel Marge CACEIS	COLLATERAL CASH SUR PRETÆMPRUNT DEVISE VALEUR: EUR EURO 0 COLCASH564BE4941 BNP	RESORERIE  DETTES ET CREANCES  COLLATERAL CASH SUR DERIVES LISTES  DEVISE VALEUR: EUR EURO  UR Dépôt gar. CACEIS BK	IES ENGAGEMENTS 1PS SWAPS DE TAUX DATE ECHEANCE : 16/05/28 SWAP MVA BNP PRC	FUTURES SUR INDICES	U R STATUTS DOSSIER VAL/LIQUE
CORO	EURO	36,952.16 -137,102.51	-716.75				131,637.5	5,860,000.	34,125.	10,000.	408,962.29	٢		QUANTITE ET EXPR. QUANTITE
		<b>F F</b>	EUR				OSD	ЈРҮ	EUR	EUR	EUR	EUR		DEV COT
		<u>.</u> .					0.85937662	0.00591168	1.	٢	1	0.		P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS
CUMUL (EUR)		30/06/25	30/06/25		CUMUL (EUR)		30/06/25	30/06/25	30/06/25	30/06/25	30/06/25	30/06/25	CUMUL (EUR)	E DATE COTA
(EUR)					(EUR)		0.8518976	0.00589773	. <del>.</del>	Ľ	٢	30/06/25 -4227795.5572 M	(EUR)	COURS I VALEUR F
-100,867.10		36,952.16 -137,102.51	-716.75		181,893.65		113,126.19	34,642.46	34,125.00	10,000.00	408,962.29	0.00	0.00	
-100,867.10		-137,102.51	-716.75		180,827.37		112,141.67	34,560.70	34,125.00	10,016.19	408,962.29	-42,277.96	-180,827.37	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE COUPON CO
0.00		0.00	0.00		0.00		0.00	0.00	0.00	16.19	0.00	0.00	0.00	 OURU TOTA
0.00		0.00			-1,066.28		-984.52	-81.76	0.00	16.19	0.00	-42,277.96 -0.03	-180,827.37 -0.12	PLUS OU MOINS VAL ACT NET
-0.07		-0.09	0.00		0.12		0.08	0.02	0.02	0.01	0.28	-0.03	-0.12	CT NET

Stock : Stock admi principal au 30/06/25 PORTEFEUILLE : 000MA LBPAM ISR PROTECT 80-85 MAI 2028

VL VALIDEE

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Devise de fixing : FXR Devises Reuters Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVALO4)

PORTEFEUILL		IX - TRESORERIE	AVOIRS	BQCIUSD CACE	BQCIJPY CACE	DISPONIBILITES AVOIRS DEVISE BQCIEUR GACEIS Bank	DETTES E	VALEUR
E:LBPAMISR		m	τσ	<b>DEVISE VALEUR :</b> CACEIS Bank	<b>DEVISE VALEUR: JPY YEN</b> CACEIS Bank	NIBILITES VOIRS DEVISE VALEUR: EUR EURO CACEIS Bank	DETTES ET CREANCES	E U R
PORTEFEUILLE : LBPAM ISR PROTECT 80-85 MAI 2028 (000MNA)				DEVISE VALEUR: USD DOLLAR US ELS Bank	: JPY YEN	EUR EURO		STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE
:028 (000MNA)				-84,086.98	-37,038,034.	313,746.95		QUANTITE ET EXPR. QUANTITE
				OSD	ЈРҮ	EUR		DEV
				0.85546002 30/06/25	0.00605286 30/06/25	H		P.R.U EN DEVISE DATE ET EXPR. COURS COTA
(EUR)	CUMUL (EUR)		CUMUL (EUR)	30/06/25	30/06/25	30/06/25	CUMUL (EUR)	DATE COTA
	)			0.8518976	0.00589773	٢	J	COURS I VALEUR F
143,061,638.50	517,616.81		17,627.97	-71,933.05	-224,185.93	313,746.95	499,988.84	PRIX REVIENT TOTA VALEUR BOURSIERE
146,425,071.27	522,611.86		23,673.11	-71,633.50	-218,440.34	313,746.95	498,938.75	
16.19	16.19		0.00	0.00	0.00	0.00	16.19	ortefeuille
3,363,432.77 100.00	4,995.05 0.36		6,045.14 0.02	299.55 -0.05	5,745.59 -0.15	0.00	-1,050.09 0.34	PLUS OU MOINS VAL AC
100.00	0.36		0.02	-0.05	-0.15	0.00 0.21	0.34	ACT NET

PAGE 3 / 5

Inventaire sur historique de valorisation (HISIN)

Stock: Stock admi principal au 30/06/25 PORTEFEUILLE: 000MVA LBPAM ISR PROTECT 80-85 MAI 2028

Devise de fixing : FXR Devises Reuters
Devise du portefeuille : EUR

PAGE 4 / 5

VL VALIDEE (Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVALO4)

Precedente VL en date du 27/06/25 : Ω LBPAM ISR 8085 0528 Prec. VL: 108.78(EUR) Variation: -0.037%

Part Devise C1 FR001400D2D0 LBPAM ISR 8085 0528 EUR

Actif net 146,425,071.27

Nombre de parts 1,346,508.29879

Valeur liquidative 108.74

100.

Coefficient

Coeff resultat Change

Prix std Souscript. 108.74

Prix std Rachat 108.74

Actif net total en EUR :

146,425,071.27

Frais de gestion du jour Prov cotisation AMF : Frais gest rétro in : Frais de Gest. Fixe :

11.31 -3,642.85 13,239.3

Portefeuille titres :

145,902,459.41

## Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

**CACEIS**OLISFA le 01/07/25 23:08:33

Inventaire sur historique de valorisation (HISIN)

Stock: Stock admi principal au 30/06/25 PORTEFEUILLE: 000MVA LBPAM ISR PROTECT 80-85 MAI 2028

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXR Devises Reuters
Devise du portefeuille : EUR

PAGE 5 / 5

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVALO4)

COURS INVERSES DES DEVISES UTILISEES

Cours EUR en JPY : Cours EUR en USD :

169.55675 1.17385

cotation : 30/06/25 cotation : 30/06/25

00

169.77625 1.1718

par la valorisation

COURS DES DEVISES UTILISEES

par l'inventaire

par l'inventaire

Cours JPY en EUR : Cours USD en EUR :

0.0058977304 0.8518976019

cotation: cotation:

30/06/25 30/06/25

00

par la valorisation

par la valorisation précédente 0.0058901054 0.8533879502 cotation : 27/06/25 cotation : 27/06/25

cotation : 27/06/25 cotation : 27/06/25

par la valorisation précédente

-0.12929 0.17494

variation