



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

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			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

(*) 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				
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

(*) 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				
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

(*) 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)	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	1 346 508,29879	108,74

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPER INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

Inventaire sur historique de valorisation (HISIMV)

[illegible]

OPCVM ET EQUIVALENTS D'AUTRES ETATS MEMBRE DE L'UE

[illegible]

FR0013239407 LBPAN ISR ALISA500 R	109,786.9452	P EUR	223.9847	M 30/06/25	227.93	5	24,590,597.84	25,023,738.42	0.00	433,140.58	17.09
III - TITRES D OPC											
					CMUL (EUR)		142,544,021.69	146,125,564.74	0.00	3,581,543.05	99.80

ENGAGEMENTS A TERME FERMES

SOUS-JACENT : MXXEF MSCI EMERGING MARKETS

FINL00000080H	MSCI EMG MKT 09/25	-9.	USD	1182.1667	M 30/06/25	1233.5	4	0.00	-19,678.83	-0.01
S&P-JACENT : NKY TOKYO NIKKEI 225 AVERAGE										
FINL00000080M	OMX TOKYO NIK 09/25	-1.	JPY	37870.	M 30/06/25	40510.	4	0.00	-15,570.01	-0.01
S&P-JACENT : SPX S&P 500 INDEX										
FINL000000812	SP 500 MINT 09/25	-9.	USD	6012.5556	M 30/06/25	6253.75	4	0.00	-92,462.84	-0.06
S&P-JACENT : SXSE EURO STOXX 50										
FINL00000080E	EURO STOXX 50 09/25	-33.	EUR	5250.2727	M 30/06/25	5327.	4	0.00	-25,320.00	-0.02
S&P-JACENT : SXXP STOXX EUROPE 600										
FINL00000080P	DJE 600 EURO P 09/25	-42.	EUR	538.4071	M 30/06/25	542.6	4	0.00	-8,805.00	-0.01
S&P-JACENT : TPX TOPIX INDEX (TOKYO)										
FINL00000080F	OSE TOP1X INT 09/25	-4.	JPY	2775.	M 30/06/25	2855.5	4	0.00	-18,990.69	-0.01

Inventaire sur historique de valorisation (HISIM)

Stock : Stock admin principal au 30/06/25
PORTEFEUILLE : 0000NA LBPM ISR PROTECT 80-85 MAI 2028

VL VALIDEE

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

(Etat simplifié, trame : PC3 TRI AMF/TYRE 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 BOURSIERE	Coupon COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL ACT NET
FUTURES SUR INDICES												

VII - AUTRES ENGAGEMENTS															
SWAPS															
SWAPS DE TAUX															
DATE ECHÉANCE : 16/05/28															
PSM037491	SWAP MVA BNP	PRC	1.	EUR	0.	30/06/25	-4227795.5572	M	0.00	-42,277.96	0.00	-42,277.96	-0.03		

IX - TRESORERIE															
DETTES ET CREANCES															
COLLATERAL CASH SUR DERIVES LISTES															
DEVISE VALEUR : EUR EURO															
DOMCEUR	Dépôt gar. CACEIS BK		408,962.29	EUR	1.	30/06/25	1.		408,962.29	408,962.29	0.00	0.00	0.28		
COLLATERAL CASH SUR PRETEMPRUNT															
DEVISE VALEUR : EUR EURO															
5648E4941+00 COLCASH648E4941 BNP			10,000.	EUR	1.	30/06/25	1.		10,000.00	10,016.19	16.19	16.19	0.01		
APPELS DE MARGE															
DEVISE VALEUR : EUR EURO															
MARCEUR	Appel Marge CACEIS		34,125.	EUR	1.	30/06/25	1.		34,125.00	34,125.00	0.00	0.00	0.02		
DEVISE VALEUR : JPY YEN															
MARCIJY	Appel Marge CACEIS		5,860,000.	JPY	0.00591168	30/06/25	0.00589773		34,642.46	34,560.70	0.00	-81.76	0.02		
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US															
MARCIUSD	Appel Marge CACEIS		131,637.5	USD	0.85937662	30/06/25	0.8518976		113,126.19	112,141.67	0.00	-984.52	0.08		
APPELS DE MARGE															
										CUMUL (EUR)	181,893.65	180,827.37	0.00	-1,066.28	0.12
FRAIS DE GESTION															
DEVISE VALEUR : EUR EURO															
FGAMEUR	Prov cotisation AMF		-716.75	EUR	1.	30/06/25	1.		-716.75	-716.75	0.00	0.00	0.00		
FGPFEUR	Frais gest rétro tn		36,952.16	EUR	1.	30/06/25	1.		36,952.16	36,952.16	0.00	0.00	0.03		
FGPVCEUR	Frais de Gest. Fixe		-137,102.51	EUR	1.	30/06/25	1.		-137,102.51	-137,102.51	0.00	0.00	-0.09		
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO										CUMUL (EUR)	-100,867.10	-100,867.10	0.00	0.00	-0.07

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	<-----> PRUX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL ACT NET			
DETTES ET CREANCES										CUMUL (EUR)	499,988.84	498,938.75	16.19	-1,050.09	0.34
DISPONIBILITES															
AVOIRS															
DEVISE VALEUR : EUR EURO															
BCCIEUR	CACEIS Bank		313,746.95	EUR	1.	30/06/25	1.		313,746.95	313,746.95	0.00	0.00	0.21		
DEVISE VALEUR : JPY YEN															
BCCJPY	CACEIS Bank		-37,038,034.	JPY	0.00605286	30/06/25	0.00589773		-224,185.93	-218,440.34	0.00	5,745.59	-0.15		
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US															
BCCUSD	CACEIS Bank		-84,086.98	USD	0.85546002	30/06/25	0.8518976		-71,933.05	-71,633.50	0.00	299.55	-0.05		
AVOIRS										CUMUL (EUR)	17,627.97	23,673.11	0.00	6,045.14	0.02
IX - TRESORERIE										CUMUL (EUR)	517,616.81	522,611.86	16.19	4,995.05	0.36
PORTEFEUILLE : LBPAM ISR PROTECT 80-85 MAI 2028 (000MNA)										(EUR)	143,061,638.50	146,425,071.27	16.19	3,363,432.77	100.00

Portefeuille titres :		145,902,459.41							
<u>Frais de gestion du jour</u>									
Prov cotisation AMF :		11.31	EUR						
Frais gest rétro in :		-3,642.85	EUR						
Frais de Gest. Fixe :		13,239.3	EUR						
Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
CI FR0014000200 LBPAM ISR 8085 0528	EUR	146,425,071.27	1,346,508.29879	108.74	100.			108.74	108.74
Actif net total en EUR :		146,425,071.27							
Precedente VL en date du 27/06/25 :									
CI	LBPAM ISR 8085 0528	Prec. VL :	108.78	(EUR)	Variation :		-0.037%		

COURS DES DEVISES UTILISEES				
par 1a valorisation		par 1' inventaire		variation
Cours EUR en JPY :	169.55675	cotation :	30/06/25	0.
Cours EUR en USD :	1.17385	cotation :	30/06/25	0.
		par 1a valorisation précédente		
		169.77625		-0.12929
		1.1718		0.17494

COURS INVERSES DES DEVISES UTILISEES				
par 1a valorisation		par 1' inventaire		par 1a valorisation précédente
Cours JPY en EUR :	0.0058977304	cotation :	30/06/25	0.
Cours USD en EUR :	0.8518976019	cotation :	30/06/25	0.
		0.0058901054		cotation : 27/06/25
		0.8533879502		cotation : 27/06/25