

Composition de l'actif

au 30 septembre 2024

LBPAM 3 MOIS

Part R, Part E, Part I

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

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			2 064 410 227,11	96,55
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			2 064 410 227,11	96,55
Assurance			94 077 568,77	4,40
ASSICURAZIONI GENERALI	EUR	665 488	17 269 413,60	0,81
AXA	EUR	1123846	38 806 402,38	1,81
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG AG	EUR	55 360	27 364 448,00	1,28
SCOR SE	EUR	209 709	4 206 762,54	0,20
UNIPOL GRUPPO SPA	EUR	602 675	6 430 542,25	0,30
Automobiles			47 034 192,38	2,20
STELLANTIS NV	EUR	3 656 438	45 369 082,70	2,12
VOLKSWAGEN AG-PREF	EUR	17 498	1 665 109,68	0,08
Banques commerciales			580 995 838,97	27,17
BANCA MEDIOLANUM SPA	EUR	487 549	5 519 054,68	0,26
BANCA POPOLARE EMILIA ROMAGNA	EUR	2 769 985	13 988 424,25	0,65
BANCO BPM SPA	EUR	10 182 939	61 688 244,46	2,89
BCP BCO	EUR	27 621 000	11 197 553,40	0,52
BNP PARIBAS	EUR	1 004 622	61 834 484,10	2,89
COMMERZBANK AG	EUR	1000000	16 525 000,00	0,77
CREDIT AGRICOLE	EUR	3 162 571	43 406 286,98	2,03
DEUTSCHE BANK AG	EUR	3 293 208	51 038 137,58	2,39
ERSTE GROUP BANK	EUR	253 000	12 460 250,00	0,58
INTESA SANPAOLO	EUR	31 179 209	119 650 214,54	5,60
SOCIETE GENERALE SA	EUR	194 500	4 347 075,00	0,20
UNICREDIT SPA	EUR	4 555 852	179 341 113,98	8,39
Composants automobiles			44 507 348,42	2,08
FERRARI NV	EUR	81 562	34 231 571,40	1,60
MICHELIN (CGDE)	EUR	281 837	10 275 777,02	0,48
Conglomérats industriels			110 783 507,44	5,18
SIEMENS AG-REG	EUR	610 916	110 783 507,44	5,18
Distribution de produits alimentaires de première nécessité			8 624 717,91	0,40
BANCA GENERALI SPA	EUR	129 495	5 210 878,80	0,24
CARREFOUR	EUR	222 981	3 413 839,11	0,16
Distribution spécialisée			5 302 175,76	0,25
MONCLER SPA	EUR	92 988	5 302 175,76	0,25
Divertissement			2 293 980,00	0,11
VIVENDI	EUR	221 000	2 293 980,00	0,11
Electricité			120 180 468,93	5,62
ELEC DE PORTUGAL	EUR	2 757 977	11 313 221,65	0,53
ENEL SPA	EUR	13 737 607	98 567 330,23	4,60
LEGRAND SA	EUR	42 500	4 390 250,00	0,21
TERNA	EUR	730 671	5 909 667,05	0,28
Equipements de communication			3 460 234,21	0,16
NOKIA (AB) OYJ	EUR	881 813	3 460 234,21	0,16
, , , ,	,			-,.0

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Equipements électriques			6 849 800,00	0,32
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	29 000	6 849 800,00	0,32
Equipements et fournitures médicaux			1 707 667,10	0,08
DIASORIN SPA	EUR	16 279	1 707 667,10	0,08
Gaz			21 842 724,62	1,02
SNAM	EUR	4 778 544	21 842 724,62	1,02
Grands magasins et autres			25 569 488,36	1,20
PROSUS NV	EUR	651 286	25 569 488,36	1,20
Hôtels, restaurants et loisirs			9 986 400,00	0,47
TULAG	EUR	1460 000	9 986 400,00	0,47
Industrie aérospatiale et défense			60 087 600,00	2,81
AIRBUS SE	EUR	400 000	52 488 000,00	2,45
SAFRAN SA	EUR	36 000	7 599 600,00	0,36
Logiciels			43 998 022,91	2,06
BOUYGUES	EUR	247 887	7 451 483,22	0,35
SAP SE	EUR	30 000	6 132 000,00	0,29
VINCI SA	EUR	145 229	15 241 783,55	0,71
ZALANDO SE	EUR	512 247	15 172 756,14	0,71
Machines			42 840 726,93	2,00
INTERPUMP GROUP	EUR	79 713	3 338 380,44	0,16
SIEMENS ENERGY AG	EUR	1 194 507	39 502 346,49	1,84
Marches de capitaux			16 001 878,73	0,75
AZIMUT HOLDING	EUR	66 815	1548 771,70	0,07
FINECOBANK SPA	EUR	221 138	3 399 996,75	0,16
MEDIOBANCA SPA	EUR	721 247	11 053 110,28	0,52
Pétrole et gaz			175 159 299,28	8,19
ENI SPA	EUR	7 311 408	100 034 684,26	4,68
ITALGAS SPA	EUR	2 209 064	11 995 217,52	0,56
TOTALENERGIES SE	EUR	1 079 135	63 129 397,50	2,95
Producteur et commerce d'énergie indépendants		, , , , , ,	21 644 852,02	1,01
AIR LIQUIDE SA-PF	EUR	18 315	3 173 256,90	0,15
AIR LIQUIDE SA-PF-2025	EUR	106 612	18 471 595,12	0,86
Produits alimentaires	2011		11 342 239,92	0,53
DANONE	EUR	173 588	11 342 239,92	0,53
Produits de soins personnels	LOIK	175 555	17 147 432,50	0,80
L'OREAL SA-PF	EUR	6 000	2 412 300,00	0,11
L'OREAL SA-PF 2025	EUR	36 650	14 735 132,50	0,69
Produits pharmaceutiques	LOIK	30 030	125 881 361,36	5,89
COVESTRO AG	EUR	1 463 519	81 869 252,86	3,83
EUROAPI SASU	EUR	450	1705,50	0,00
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA	EUR	103 975	5 281 930,00	0,00
SANOFI	EUR	376 370	38 728 473,00	1,81
Produits pour l'industrie du bâtiment	LUK	3/03/0	,	
-	ELID	60.2/0	4 923 548,28	0,23
SAINT-GOBAIN Somi-conductours et águinoments neur fabrication	EUR	60 249	4 923 548,28	0,23
Semi-conducteurs et équipements pour fabrication	ELID	137,000	141 523 767,12	6,62
ASML HOLDING NV	EUR	123 899	92 379 094,40	4,32
INFINEON TECHNOLOGIES	EUR	1 562 132	49 144 672,72	2,30

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Services aux collectivités			91 397 694,67	4,27
A2A Az./ EX AEM	EUR	748 123	1 551 607,10	0,07
ENGIE SA-PF	EUR	887 815	13 774 449,73	0,64
ENGIE SA-PF 2023	EUR	1 402 048	21 752 774,72	1,02
ENGIE SA-PF-2025	EUR	2 554 887	39 639 071,81	1,85
HERA SPA	EUR	508 802	1 822 528,76	0,09
POSTE ITALIANE	EUR	693 317	8 728 861,03	0,41
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	139 851	4 128 401,52	0,19
Services de télécommunication diversifiés			61 964 460,30	2,90
DEUTSCHE TELEKOM AG	EUR	1 012 908	26 730 642,12	1,25
ORANGE	EUR	3 425 748	35 233 818,18	1,65
Services de télécommunication mobile			3 747 353,35	0,18
INFR WIRE ITAL SPA	EUR	339 127	3 747 353,35	0,18
Services financiers diversifiés			104 650 821,20	4,89
ADYEN NV	EUR	24 845	34 847 597,00	1,63
AMUNDI	EUR	20 001	1 341 067,05	0,06
BAWAG GROUP AG	EUR	76 000	5 285 800,00	0,25
DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	51 000	10 745 700,00	0,50
EURONEXT NV - W/I	EUR	428 507	41 758 007,15	1,95
EXOR NV	EUR	111 000	10 672 650,00	0,50
Soins et autres services médicaux			55 096 305,67	2,58
AMPLIFON	EUR	52 507	1 355 205,67	0,06
FRESENIUS	EUR	1 570 000	53 741 100,00	2,52
Textiles, habillement et produits de luxe			3 786 750,00	0,18
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	EUR	5 500	3 786 750,00	0,18
TITRES D'OPC			55 709 167,61	2,61
ОРСУМ			55 709 167,61	2,61
Gestion collective			55 709 167,61	2,61
LBPAM SHORT TERM PART M	EUR	345,20	3 490 918,51	0,16
OSTRUM SRI CASH Part M	EUR	2 508	26 231 247,24	1,23
OSTRUM SRI CASH Part Z2	EUR	2 489	25 987 001,86	1,22
Total			2 120 119 394,72	99,16

^(*) 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

Inventaire des opérations à terme de devises

Valeur actuelle présentée au bilan		Valeur actuelle présentée au bilan Montant de l'exp			'expositi	on (*)
Type d'opération	A	Danie.	Devi	ses à recevoir (+)	De	vises à livrer (-)
	Actif	Passif	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 bil	e présentée au an	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				
TRS PIV BNP 08072027	30 000 008,64	0,00	-5 116 483,47	30 000 008,64
TRS PIV BNP 200726	130 000 002,53	0,00	-1 154 338,92	130 000 002,53
TRS PIV CACIB 080727	99 852 506,89	0,00	-11 956 505,93	99 852 506,89
TRS PIV JPM 211128	300 000 000	951 075,00	0,00	300 000 000,00
TRS PIV NAT 24/02/25	100 000 000	0,00	-7 658 604,00	100 000 000,00
TRS PIV SG 03/06/25	179 999 998,2	25 327 806,95	0,00	179 999 998,20
TRS PIV UBS 04/04/25	99 999 994,01	0,00	-1 396 025,92	99 999 994,01
TRS PIV UBS 23012026	150 194 505,65	0,00	-20 099 953,94	150 194 505,65
TRS PIV UBS 25072025	200 000 041,91	0,00	-9 856 778,07	200 000 041,91
Sous-total 3.		26 278 881,95	-57 238 690,25	1 290 047 057,83
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		26 278 881,95	-57 238 690,25	1 290 047 057,83

^(*) 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		e présentée au an	Montant de l'exposition (*)
	Norminal	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				
TRS PIV UBS 14/12/26	319 999 995,3	0,00	-5 215 971,12	319 999 995,30
Sous-total 3.		0,00	-5 215 971,12	319 999 995,30
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	-5 215 971,12	319 999 995,30

^(*) 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		e présentée au an	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

^(*) 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	e présentée au an	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	

^(*) 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		
	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					
TRS PIV JPM 17012028	283 000 000,4	9 001 700,80	0,00	283 000 000,40	
TRS PIV NAT 23062028	120 000 000	0,00	-11 551 909,20	120 000 000,00	
Sous-total 3.		9 001 700,80	-11 551 909,20	403 000 000,40	
4. Autres instruments					
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00	
Total		9 001 700,80	-11 551 909,20	403 000 000,40	

^(*) 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)	2 120 119 394,72
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	-30 959 808,30
Total instruments financiers à terme - taux	-5 215 971,12
Total instruments financiers à terme - change	0,00
Total instruments financiers à terme - crédit	0,00
Total instruments financiers à terme - autres expositions	-2 550 208,40
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	0,00
Autres actifs (+)	85 550 184,05
Autres passifs (-)	-28 795 012,41
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	2 138 148 578,54

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part LBPAM 3 MOIS E	EUR	860 529,99709	163,51
Part LBPAM 3 MOIS I	EUR	43 455,87035	10 604,80
Part LBPAM 3 MOIS R	EUR	4 194 014,11195	366,37