



Composition de l'actif

au 31 décembre 2025

LBPAM ISR ABSOLUTE RETURN CONVERTIBLES

Action I, Action X

FORME JURIDIQUE DE L'OPC

SICAV 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			2 229 650,58	1,47
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			2 229 650,58	1,47
Industrie aérospatiale et défense			802 980,00	0,53
SAFRAN SA	EUR	2 700	802 980,00	0,53
Produits chimiques			430 920,58	0,28
SIKA AG-REG	CHF	2 466	430 920,58	0,28
Services liés aux technologies de l'information			995 750,00	0,66
CAPGEMINI SE	EUR	7 000	995 750,00	0,66
OBLIGATIONS CONVERTIBLES EN ACTIONS			121 436 659,10	79,98
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé			121 436 659,10	79,98
Boissons			1 479 030,82	0,97
DAVIDE CAMPARI MILANO 2.375% 17-01-29	EUR	1 500 000	1 479 030,82	0,97
Compagnies aériennes			3 147 480,00	2,07
DEUTSCHE LUFTHANSA AG ZCP 10-09-32	EUR	3 000 000	3 147 480,00	2,07
Electricité			1 495 579,00	0,98
LEGRAND 1.5% 23-06-33 CV	EUR	1 400 000	1 495 579,00	0,98
Equipement et services pour l'énergie			2 546 885,10	1,68
SAIPEM 2.875% 11-09-29 CV	EUR	1 700 000	2 546 885,10	1,68
Equipements électriques			6 822 814,01	4,49
NORDEX AG 4.25% 14-04-30 CV	EUR	1 000 000	2 030 750,93	1,34
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.25% 23-09-33 CV	EUR	500 000	509 469,25	0,34
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.625% 28-06-31 CV	EUR	2 000 000	2 121 694,29	1,40
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.97% 27-11-30 CV	EUR	1 700 000	2 160 899,54	1,41
Gestion et promotion immobilière			873 493,01	0,58
LEG PROPERTIES BV 1.0% 04-09-30	EUR	900 000	873 493,01	0,58
Gestion immobilière et développement			11 964 875,92	7,88
LEG IMMOBILIEN AG 0.4% 30-06-28	EUR	5 400 000	5 054 353,04	3,33
SIMON GLOBAL DEVELOPMENT BV 3.5% 14-11-26	EUR	600 000	749 392,57	0,49
TAG IMMOBILIEN AG 0.625% 11-03-31	EUR	5 000 000	5 096 313,81	3,36
VONOVIA SE ZCP 20-05-30 CV	EUR	1 100 000	1 064 816,50	0,70
Grands magasins et autres			1 322 696,21	0,87
ALIBABA GROUP 0.5% 01-06-31 CV	USD	1 000 000	1 322 696,21	0,87
Hôtels, restaurants et loisirs			4 161 326,83	2,74
ACCOR 0.7% 07-12-27 CV	EUR	45 500	2 615 249,00	1,72
SPIE 2.0% 17-01-28 DD	EUR	1 000 000	1 546 077,83	1,02
Industrie aérospatiale et défense			3 689 421,02	2,43
MTU AERO ENGINES 0.05% 18-03-27	EUR	3 300 000	3 689 421,02	2,43
Logiciels			10 023 176,25	6,60
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 1.125% 18-05-28	EUR	1 400 000	2 087 843,40	1,38
NEXI 1.75% 24-04-27 CV	EUR	2 300 000	2 251 227,62	1,48
VINCI 0.7% 18-02-30 CV	EUR	2 000 000	2 092 246,09	1,38
ZALANDO SE 0.625% 06-08-27 CV	EUR	3 700 000	3 591 859,14	2,36
Marchés de capitaux			12 942 791,05	8,52
CARA OBLIGATIONS SAS 1.5% 01-12-30	EUR	1 000 000	1 285 001,26	0,85
CITIGROUP GLOBAL MKTS FUNDING ZCP 15-03-28 CV	EUR	1 000 000	1 049 670,00	0,69
COINBASE GLOBAL ZCP 01-10-29	USD	3 000 000	2 373 970,79	1,56
GOLD SACH GR ZCP 07-05-30 CV	EUR	4 400 000	5 206 234,00	3,42

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
JP MORGAN CHASE FINANCIAL COMPANY LLC 0.1% 20-05-30	EUR	1 500 000	1 424 959,17	0,94
JP MORGAN CHASE FINANCIAL COMPANY LLC 0.5% 27-03-30	EUR	1 500 000	1 602 955,83	1,06
Métaux et minerais			3 936 815,74	2,59
RAG STIFTUNG 1.875% 16-11-29	EUR	2 900 000	2 924 373,86	1,92
RAG STIFTUNG 2.25% 28-11-30 CV	EUR	1 000 000	1 012 441,88	0,67
Outils et services appliqués aux sciences biologiques			6 164 580,28	4,06
QIAGEN NV 2.0% 04-09-32 CV	USD	3 800 000	3 307 385,55	2,18
QIAGEN NV 2.5% 10-09-31 CV	USD	3 200 000	2 857 194,73	1,88
Semi-conducteurs et équipements pour fabrication			9 313 757,83	6,13
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV 1.875% 06-04-29	EUR	2 000 000	2 682 705,00	1,77
STMICROELECTRONICS NV ZCP 04-08-27	USD	8 000 000	6 631 052,83	4,36
Services aux collectivités			6 162 710,16	4,06
IBERDROLA FINANZAS SAU 0.8% 07-12-27 CV	EUR	3 600 000	5 041 016,51	3,32
IBERDROLA FINANZAS SAU 1.5% 27-03-30 CV	EUR	1 000 000	1 121 693,65	0,74
Services aux entreprises			8 131 053,96	5,35
CMA CGM 0.5% 16-12-28 CV	EUR	800 000	867 352,84	0,57
ELIS EX HOLDELIS 2.25% 22-09-29	EUR	400 000	618 075,04	0,41
LAGFIN SCA 3.5% 08-06-28 CV	EUR	2 200 000	2 172 626,08	1,43
SAGERPAR ZCP 01-04-26 CV	EUR	4 500 000	4 473 000,00	2,94
Services clientèle divers			2 976 975,00	1,96
EDENRED ZCP 14-06-28 CV	EUR	50 000	2 976 975,00	1,96
Services de télécommunication diversifiés			6 328 736,44	4,17
CELLNEX TELECOM 0.75% 20-11-31 CV	EUR	7 000 000	6 328 736,44	4,17
Services financiers diversifiés			14 991 700,47	9,90
CITIGROUP GLOBAL MKTS 0.8% 05-02-30 CV	EUR	2 800 000	3 080 043,53	2,03
CITIGROUP GLOBAL MKTS 1.0% 09-04-29 CV	EUR	5 900 000	5 965 161,05	3,95
EURONEXT NV 1.5% 30-05-32 CV	EUR	500 000	497 054,26	0,33
FERROVIAL SE 0.75% 20-05-31 CV	EUR	400 000	405 659,00	0,27
MERRILL LYNCH BV 0.1% 28-04-30 CV	EUR	1 500 000	1 411 524,17	0,93
ORPAR 2.0% 07-02-31 CV	EUR	800 000	774 061,42	0,51
WENDEL 2.625% 27-03-26 CV	EUR	2 800 000	2 858 197,04	1,88
Soins et autres services médicaux			2 960 760,00	1,95
FRESENIUS SE 0.0% 11-03-28 CV	EUR	3 000 000	2 960 760,00	1,95
OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			5 849 265,14	3,85
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			5 849 265,14	3,85
Machines			1 116 435,00	0,74
EXAIL TECHNOLOGIES 4.0% PERP	EUR	1 000 000	1 116 435,00	0,74
Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC)			4 732 830,14	3,11
COVIVIO 1.625% 23-06-30	EUR	5 000 000	4 732 830,14	3,11
TITRES D'OPC			14 409 997,70	9,49
OPCVM			14 409 997,70	9,49
Gestion collective			14 409 997,70	9,49
OSTRUM SRI CASH Part M	EUR	1182	12 752 467,98	8,40
OSTRUM SRI CASH Z	EUR	154	1 657 529,72	1,09
CRÉANCES REPRÉSENTATIVES DE TITRES PRÊTÉS			514 000,51	0,34
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé			514 000,51	0,34
Marchés de capitaux			514 000,51	0,34
CARA OBLIGATIONS SAS 1.5% 01-12-30	EUR	400 000	514 000,51	0,34
INDEMNITÉS SUR TITRES PRÊTÉS			1 136,16	0,00
TITRES FINANCIERS DONNÉS EN PENSION			1 121 693,65	0,74
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé			1 121 693,65	0,74

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Services aux collectivités			1 121 693,65	0,74
IBERDROLA FINANZAS SAU 1.5% 27-03-30 CV	EUR	1 000 000	1 121 693,65	0,74
DETTES REPRÉSENTATIVES DES TITRES DONNÉS EN PENSION			-1 088 000,00	-0,72
INDEMNITÉS SUR TITRES DONNÉS EN PENSION			-2 664,66	0,00
TOTAL			144 471 738,18	95,15

(*) 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 0326	-31	0,00	-19 405,00	-1 810 710,00
Sous-total 1.		0,00	-19 405,00	-1 810 710,00
2. Options				
EURO STOXX 50 03/2026 PUT 5400	125	52 875,00	0,00	-1 172 760,53
EURO STOXX 50 06/2026 CALL 5650	170	527 340,00	0,00	5 858 011,22
EURO STOXX 50 06/2026 PUT 5650	170	304 810,00	0,00	-3 839 704,83
Sous-total 2.		885 025,00	0,00	845 545,86
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
CFD MS ASML HOL 1230	-1 350	12 960,00	0,00	-1 243 890,00
CFD MS COINBASE 1230	-2 235	46 205,29	0,00	-430 348,59
CFD MS EURONEXT 1230	-1 020	0,00	-3 978,00	-130 560,00
CFD MS FERRARI 1230	-590	0,00	-2 773,00	-188 033,00
CFD MS FERROVIA 1230	-200	355,43	0,00	-11 068,00
CFD MSF TEG EUR 1230	-87 630	0,00	-12 268,20	-1 159 344,90
CFD MS MTU AERO 1230	-2 710	0,00	-271,00	-962 863,00
CFD MS SAIPEM S 1230	-367 408	0,00	-35 271,17	-890 964,40
MS ACCOR SA 1230	-9 080	0,00	-10 163,20	-437 837,60
MS AIRBUS SE 1230	-1 133	0,00	-2 583,24	-224 787,20
MS AIR FRANCE 1230	-25 515	0,00	-5 655,50	-295 080,98
MS ALIBABA GR 1230	-8 550	25 552,81	0,00	-1 067 102,90
MS BE SEMICONDU 1230	-7 835	0,00	-10 185,50	-1 047 931,25
MS DEUTSCHE L 1230	-152 486	16 163,52	0,00	-1 281 797,32
MS DHL GROUP 1230	-16 110	5 960,70	0,00	-752 820,30
MS ELIS SA 1230	-20 830	0,00	-13 331,20	-505 335,80
MS EVONIK IND 1230	-40 295	0,00	-8 864,90	-538 341,20
MS FRESENIUS 1230	-11 570	0,00	-9 140,30	-471 593,20
MS IBERDROLA 1230	-265 845	0,00	-91 884,46	-4 908 827,93
MS INTL CONSO 1230	-232 920	1 867,31	0,00	-1 105 179,59
MS KERING 1230	-731	2 229,55	0,00	-220 031,00
MS LEG IMMOBI 1230	-885	0,00	-1 504,50	-55 091,25
MS NORDEX SE 1230	-27 920	11 726,40	0,00	-813 030,40
MS QIAGEN N.V 1230	-19 750	0,00	-10 270,00	-767 386,25
MS SCHNEIDER 1230	-3 200	24 960,00	0,00	-751 680,00
MS STMICROELECTRONIC	-30 560	0,00	-305,60	-686 836,00
Sous-total 4.		147 981,01	-218 449,77	-20 947 762,06
TOTAL		1 033 006,01	-237 854,77	-21 912 926,20

(*) 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				
EC EURUSD 0326	126	95 214,78	0,00	15 797 607,39
RP EURGBP 0326	11	0,00	-5 397,13	1 378 385,73
Sous-total 1.		95 214,78	-5 397,13	17 175 993,12
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		95 214,78	-5 397,13	17 175 993,12

(*) 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)	144 471 738,18
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	795 151,24
Total instruments financiers à terme - taux	0,00
Total instruments financiers à terme - change	89 817,65
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 (+)	7 399 199,04
Autres passifs (-)	-914 069,67
Passifs de financement (-)	0,00
TOTAL = ACTIF NET	151 841 836,44

Libellé de l'action	Devise de l'action	Nombre d'actions	Valeur liquidative
Action LBPAM ISR ABSOLUTE RETURN CONVERTIBLES I	602 811,00000	110,83	
Action LBPAM ISR ABSOLUTE RETURN CONVERTIBLES X	EUR	7 455,27297	11 404,92

Stock : Stock admi principal au 31/12/25
PORTFEUILLE : 00050X LBPAM ISR ABSOLUTE RETURN CONVERTIBLES VL VALIDEE
Devise de fixing : FRX Devises Reuters
Devise du portefeuille : EUR
(Etat simplifie, trame : PC3 TRF AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BAL04)

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

V	A	L	E	U	R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	PRUX	REVENIR	TOTA	VALEUR	BOURSIERE	COURON	COURU	TOTA	PLUS	OU	MOINS	VAL	ACT	NET
						VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F														

0 - ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES

ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE OU ASSIMILE

DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE																													
CH0418792922	SIXA	AG-REG						2,466.	P	CHF	246.2	M 30/12/25	162.6	T		634,939.55		430,920.58				0.00			-204,018.97	0.28			
DEVISE VALEUR : EUR EURO																													
FR0000125338	CARPENTIN	SE						7,000.	P	EUR	110.	M 31/12/25	142.25	T		770,000.00		995,750.00				0.00			225,750.00	0.66			
FR0000073272	SARREN	SA						2,700.	P	EUR	246.2389	M 31/12/25	297.4	T		664,845.00		802,980.00				0.00			138,135.00	0.53			
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO															CMUL (EUR)										1,434,845.00	1,798,730.00	0.00	363,885.00	1.18

I - OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES

OBLIGATIONS CONVERTIBLES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE

DEVISE VALEUR : EUR EURO																											
FR0013521085	ACCOR	0.7 12-27	(UST) 071227	45,500.	P	EUR	49.3732	M 31/12/25	57.478	4		2,246,479.64		2,615,249.00				1,007.75				368,769.36	1.72				
XS2465773070	BE SMT	1.875 04-29	(UST) 060429	2,000,000.	M	EUR	109.8502	% 31/12/25	133.6665	4		2,197,004.46		2,682,705.00				9,375.00				485,700.54	1.77				
FR0014010053	CARA	08 1.5 12-30	PRETERIT/2264629	400,000.	M	EUR	99.9464	% 31/12/25	128.3765	4		399,785.71		514,000.51				494.51				114,214.80	0.34				
			(UST) 011230	1,000,000.	M	EUR	99.9464	% 31/12/25	128.3765	4		999,464.29		1,285,001.26				1,236.26				285,536.97	0.85				
XS257580857	CELL	TE 0.75 11-31	(366) 201131	7,000,000.	M	EUR	90.3578	% 31/12/25	90.316	4		6,325,047.26		6,328,736.44				6,616.44				3,689.18	4.17				
XS2982266343	CITI	CL 0.8 02-30	(366) 090230	2,800,000.	M	EUR	101.3012	% 31/12/25	109.2695	4		2,836,432.88		3,080,043.53				20,497.53				243,610.65	2.03				
XS2782912518	CITI	CL 1.0 04-29	(366) 090429	5,900,000.	M	EUR	100.7669	% 31/12/25	100.351	4		5,945,248.84		5,965,161.05				44,452.05				19,912.21	3.93				
XS2566032095	CITI	CL08 ZCP 03-28	(999) 130328	1,000,000.	M	EUR	101.5	% 31/12/25	104.967	4		1,015,000.00		1,049,670.00				0.00				34,670.00	0.69				
FR0014014M12	CMA	CM 0.5 12-28	(UST) 161228	800,000.	M	EUR	100.	% 31/12/25	108.3985	4		800,000.00		867,352.84				164.84				67,352.84	0.57				
XS2740429589	DANI	CA 2.375 01-29	(UST) 170129	1,500,000.	M	EUR	90.0418	% 31/12/25	97.492	4		1,575,627.61		1,479,030.82				16,650.82				-96,596.79	0.97				
DE000404FHZ5	DEUT	LUFZ ZCP 09-32	(999) 100932	3,000,000.	M	EUR	98.72	% 31/12/25	104.916	4		2,961,600.00		3,147,480.00				0.00				185,880.00	2.07				
FR0014003YH6	EDENRED	ZCP 06-28	(999) 140628	50,000.	P	EUR	58.74	M 31/12/25	59.5395	4		2,937,000.00		2,976,975.00				0.00				39,975.00	1.96				
FR001400AFL9	ELIS	EX 2.25 09-29	(366) 220929	400,000.	M	EUR	130.1647	% 31/12/25	153.8715	4		520,658.69		618,075.04				2,589.04				97,416.35	0.41				
IT0006769316	EURO	NV 1.5 05-32	(366) 300532	500,000.	M	EUR	100.	% 31/12/25	99.2625	4		500,000.00		497,054.26				741.76				-2,945.74	0.33				
XS168182692	FERR	SE 0.75 05-31	(EUR) 200531	400,000.	M	EUR	100.	% 31/12/25	101.321	4		400,000.00		405,659.00				375.00				5,659.00	0.27				
DE000404F5R9	FRES	SE 0.0 03-28	(366) 110328	3,000,000.	M	EUR	100.5804	% 31/12/25	98.692	4		3,017,412.00		2,960,760.00				0.00				-56,652.00	1.95				
XS2958341708	GOLD	SAGH ZCP 05-30	(999) 070530	4,400,000.	M	EUR	100.8182	% 31/12/25	118.3235	4		4,436,000.08		5,206,233.00				0.00				770,233.92	3.43				
XS257565830	IBER	FI 0.8 12-27	(UST) 071227	3,600,000.	M	EUR	100.9369	% 31/12/25	139.9645	4		3,633,729.98		5,041,016.51				2,294.51				1,407,286.53	3.32				
XS3034368806	IBER	FI 1.5 03-30	MPLIV CR1323410130	1,000,000.	M	EUR	100.	% 31/12/25	111.755	4		1,000,000.00		1,121,693.65				4,143.65				121,693.65	0.74				
			(UST) 270330	1,000,000.	M	EUR	100.	% 31/12/25	111.755	4		1,000,000.00		1,121,693.65				4,143.65				121,693.65	0.74				
XS243113101	INTE	CO 1.125 05-28	(UST) 180528	1,400,000.	M	EUR	122.7523	% 31/12/25	148.9825	4		1,718,531.91		2,087,843.40				2,088.40				369,311.49	1.38				
XS307614793	JP MORG	0.1 05-30	(EUR) 200530	1,500,000.	M	EUR	100.0003	% 31/12/25	94.937	4		1,500,004.17		1,424,959.17				904.17				-75,005.00	0.94				
XS3041309207	JP MORG	0.5 03-30	(EUR) 270330	1,500,000.	M	EUR	100.	% 31/12/25	106.479	4		1,500,000.00		1,602,955.83				5,770.83				102,955.83	1.06				
XS2630795404	LAF	SC 3.5 06-28	(UST) 080628	2,200,000.	M	EUR	97.5949	% 31/12/25	98.4865	4		2,147,088.79		2,172,626.08				5,923.08				25,537.29	1.43				
DE0004289123	LEG	DM 0.4 06-28	(UST) 300628	5,400,000.	M	EUR	91.6729	% 31/12/25	93.41	4		4,950,335.55		5,054,353.04				10,213.04				104,017.49	3.33				
DE0004312D1	LEG	PM 1.0 09-30	(UST) 040930	900,000.	M	EUR	102.256	% 31/12/25	96.715	4		920,303.92		873,493.01				3,058.01				-46,810.91	0.58				
FR0014010NZ3	LEGAND	1.5 06-33	(UST) 220633	1,400,000.	M	EUR	100.9532	% 31/12/25	106.7735	4		1,413,344.26		1,495,579.00				750.00				82,234.74	0.98				
XS2938565673	MERL	LY 0.1 04-30	(999) 280430	1,500,000.	M	EUR	100.	% 31/12/25	94.0355	4		1,500,000.00		1,411,524.17				991.67				-88,475.83	0.93				
DE00042XPEV6	MTU	AFR 0.05 03-27	(366) 180327	3,300,000.	M	EUR	90.8154	% 31/12/25	111.7605	4		2,996,908.20		3,689,421.02				1,324.52				692,512.82	2.43				
XS2161819722	NEXI	1.75 04-27	(UST) 240427	2,300,000.	M	EUR	95.7936	% 31/12/25	97.5285	4		2,203,251.68		2,251,227.62				8,072.12				47,975.94	1.48				

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 31/12/25
PORTFEUILLE : 00050X LBPAM ISR ABSOLUTE RETURN CONVERTIBLES VL VALIDEE
Devise de fixing : FRX Devises Reuters
Devise du portefeuille : EUR
(Etat simplifié, trame : PC3 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BAL00)

V A L E U R		STATUS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	PRIX	REVENIR	TOTA	VALEUR	BOURSIERE	COUPON	COURU	TOTA	PLUS OU MOINS	VAL	ACT	NET	
		VAL./LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR.	COURS	COTA	VALEUR	F	PRUX	REVENIR	TOTA	VALEUR	BOURSIERE	COUPON	COURU	TOTA	PLUS OU MOINS	VAL	ACT	NET
DE000A351MA2	NORD AG 4.25 04-30	(UST)	140430	1,000,000.	M EUR	110.9005	% 31/12/25	202.106	4	1,109,005.49	2,030,750.93	9,690.93	921,745.44	1.34								
FR001400N10	ORPAR 2.0 02-31	(366)	070231	800,000.	M EUR	96.9295	% 31/12/25	94.9385	4	775,436.30	774,061.42	14,553.42	-1,374.88	0.51								
DE000A30VM9	RAG STI 1.875 11-29	(UST)	161129	2,900,000.	M EUR	100.4225	% 31/12/25	100.5815	4	2,912,253.85	2,924,373.86	7,510.36	12,120.01	1.93								
DE000A352B25	RAG STI 2.25 11-30	(UST)	281130	1,000,000.	M EUR	99.68	% 31/12/25	101.008	4	996,800.00	1,012,441.88	2,361.88	15,641.88	0.67								
BE6327660591	SACERPAR ZCP 04-26	(999)	010426	4,500,000.	M EUR	100.06	% 31/12/25	99.4	4	4,502,700.00	4,473,000.00	0.00	-29,700.00	2.95								
XS267538493	SALPEN 2.875 09-29	(UST)	110929	1,700,000.	M EUR	104.359	% 31/12/25	148.8955	4	1,774,102.49	2,546,885.10	15,661.60	772,782.61	1.68								
FR0014012R72	SCN EL 1.25 09-33	(UST)	230933	500,000.	M EUR	99.97	% 31/12/25	101.552	4	499,850.00	509,469.25	1,709.25	9,619.25	0.34								
FR001400RJR6	SCN EL 1.625 06-31	(UST)	280631	2,000,000.	M EUR	100.	% 31/12/25	106.049	4	2,000,000.00	2,121,694.29	714.29	121,694.29	1.40								
FR001400M9F9	SCN EL 1.97 11-30	(UST)	271130	1,700,000.	M EUR	116.9953	% 31/12/25	126.8995	4	1,988,920.60	2,160,899.54	3,608.04	171,978.94	1.42								
XS271344195	SIND CL 3.5 11-26	(UST)	141126	600,000.	M EUR	103.2177	% 31/12/25	124.396	4	619,306.48	749,392.57	3,016.57	130,086.09	0.49								
FR001400FK3	SPIE 2.0 01-28	(UST)	170128	1,000,000.	M EUR	111.6809	% 31/12/25	153.673	4	1,116,809.13	1,546,077.83	9,347.83	429,268.70	1.02								
DE000400FC57	TAG IMW 0.625 03-31	(UST)	110331	5,000,000.	M EUR	104.5616	% 31/12/25	101.726	4	5,228,080.47	5,096,313.81	10,013.81	-131,766.66	3.36								
FR001400XES0	VINCI 0.7 02-30	(UST)	180230	2,000,000.	M EUR	101.7888	% 31/12/25	104.346	4	2,035,775.76	2,092,246.09	5,326.09	56,470.33	1.38								
DE000400FHK7	VONOVIA SE ZCP 05-30	(999)	200530	1,100,000.	M EUR	100.	% 31/12/25	96.8015	4	1,100,000.00	1,064,816.50	0.00	-35,183.50	0.70								
FR001400Q6B0	MENDEL 2.625 03-26	(366)	270326	2,800,000.	M EUR	99.5568	% 31/12/25	100.036	4	2,787,590.16	2,858,197.04	57,189.04	70,606.88	1.88								
DE000A3E4597	ZALA SE 0.625 08-27	(366)	060827	3,700,000.	M EUR	95.7259	% 31/12/25	96.817	4	3,541,857.20	3,591,859.14	9,630.14	50,001.94	2.37								
Sous TOTAL DEVISE VALEUR : EUR		EURO																				
				CMUL (EUR)																		
				98,584,747.85																		
				106,580,053.15																		
				304,211.90																		
				7,995,305.30																		
				70.19																		
DEVISE VALEUR : USD		DOLLAR US																				
US01609M669	ALB GR 0.5 06-31	(EUR)	010631	1,000,000.	M USD	98.4546	% 31/12/25	155.301	4	918,248.05	1,322,696.21	366.61	404,448.16	0.87								
US19260QAC29	COIN GLOB ZCP 10-29	(999)	011029	3,000,000.	M USD	96.2	% 31/12/25	92.937	4	2,491,797.62	2,373,970.79	0.00	-117,826.83	1.56								
DE000404EFBU1	QJAC NV 2.0 09-32	(EXA)	040932	3,800,000.	M USD	100.4807	% 31/12/25	101.546	4	3,261,565.82	3,307,385.55	21,806.77	45,819.73	2.18								
DE000A310619	QJAC NV 2.5 09-31	(UST)	100931	3,200,000.	M USD	102.3565	% 31/12/25	104.0555	4	3,043,581.48	2,857,194.73	22,015.71	-186,386.75	1.88								
XS211997239	STML NV ZCP 08-27	(999)	040827	8,000,000.	M USD	97.2988	% 31/12/25	97.348	4	7,317,726.07	6,631,052.83	0.00	-686,673.24	4.37								
Sous TOTAL DEVISE VALEUR : USD		DOLLAR US																				
				CMUL (EUR)																		
				17,032,919.04																		
				16,492,300.11																		
				44,189.09																		
				-540,618.93																		
				10.86																		
AUTRES OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE																						
OBLIGATIONS A TAUX FIXE NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE																						
DEVISE VALEUR : EUR EURO																						
FR0013519279	COAL 1.625 06-30	(366)	230630	5,000,000.	M EUR	94.9731	% 31/12/25	93.784	6	4,748,655.14	4,732,830.14	43,630.14	-15,825.00	3.12								
OBLIGATIONS FIX TO FLOAT																						
DEVISE VALEUR : EUR EURO																						
FR00140112G1	EXAL TE 4.0 PRP	(UST)	311299	1,000,000.	M EUR	102.4	% 31/12/25	110.6435	4	1,024,000.00	1,116,435.00	10,000.00	92,435.00	0.74								
AUTRES OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE																						
CMUL (EUR)																						
5,772,655.14																						
5,849,265.14																						
53,630.14																						
76,610.00																						
3.85																						
-OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES																						
CMUL (EUR)																						
121,390,322.03																						
128,921,618.40																						
402,031.13																						
7,531,296.37																						
84.91																						

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 31/12/25
Devise de fixing : FRF Devises Reuters
Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifié, trame : PC3 TRJ AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BAL04)

PORTFEUILLE : 00050X LBPAM ISR ABSOLUTE RETURN CONVERTIBLES

VL VALDEE

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 BOURSEIERE	COURON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL ACT NET
-------------	---------	---------	-------------------------------	------------	-----------------------------------	--------------	-----------------	--------	----------------------	---	----------------------	------------------------------

III - TITRES D OPC

OPCVM ET EQUIVALENTS D AUTRES ETATS MEMBRE DE L UE

DEVISE VALEUR : EUR EURO												
FR0010392951 OSTRUM SRI CASH M	1,182.	P EUR	10756,8378	M 01/01/26	10788,89	5	12,714,582,29	12,752,467,98	0,00	37,885,69	8,40	
FR0012750461 OSTRUM SRI CASH Z	154.	P EUR	10724,724	M 01/01/26	10763,18	5	1,651,607,49	1,657,529,72	0,00	5,922,23	1,09	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO			CUMUL (EUR)									
			14,366,189,78 14,409,997,70 0,00 43,807,92 9,49									

IV - OPERATIONS TEMPORAIRES SUR TITRES

CREANCE REPRESENTATIVE DE TITRES FINANCIERS PRETES

DATE ECHÉANCE : 04/01/49

FTT/2264629 CARA OB 1,5 12-30	PRET 3,0	040149	504,960.	EUR	0.	% 31/12/25	0,00	1,136,16	1,136,16	1,136,16	0,00	
TITRES FINANCIERS DONNES EN PENSION (dont SBB)												
DATE ECHÉANCE : 04/01/49												
CRI32410130 IBER FI 1,5 03-30	MPLIV -0,2	040149	-1,088,000.	EUR	100.	% 31/12/25	-1,088,000,00	-1,090,664,66	-2,664,66	-2,664,66	-0,72	
IV - OPERATIONS TEMPORAIRES SUR TITRES			CUMUL (EUR)									
			-1,088,000,00 -1,089,528,50 -1,528,50 -1,528,50 -0,72									

VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME

ENGAGEMENTS A TERME FERMES

FUTURES SUR DEVISES

SOUS-JACENT : CMEEC EUR/USD CME

FXPL00000006 EC EURUSD 0326	126.	USD	1,1709	M 31/12/25	1,178	4	0,00	95,214,78	0,00	95,214,78	0,06	
-----------------------------	------	-----	--------	------------	-------	---	------	-----------	------	-----------	------	--

SOUS-JACENT : CMEHP EUR/GBP CME

FXPL00000008 RP EURGBP 0326	11.	GBP	0,8787	M 31/12/25	0,8753	4	0,00	-5,397,13	0,00	-5,397,13	0,00	
-----------------------------	-----	-----	--------	------------	--------	---	------	-----------	------	-----------	------	--

FUTURES SUR DEVISES

CUMUL (EUR)

			0,00 89,817,65 0,00 89,817,65 0,06									
--	--	--	------------------------------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--

FUTURES SUR INDICES

SOUS-JACENT : SXSE EURO STOXX 50

FXNL0000001E EURO STOXX 50 0326	-31.	EUR	5778,4032	M 31/12/25	5841.	5	0,00	-19,405,00	0,00	-19,405,00	-0,01	
---------------------------------	------	-----	-----------	------------	-------	---	------	------------	------	------------	-------	--

ENGAGEMENTS A TERME FERMES

CUMUL (EUR)

			0,00 70,412,65 0,00 70,412,65 0,05									
--	--	--	------------------------------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--

ENGAGEMENTS A TERME CONDITIONNELS

Stock : Stock admi principal au 31/12/25
PORTFEUILLE : 00050X LBPAM ISR ABSOLUTE RETURN CONVERTIBLES

VL VALIDEE

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

(Etat simplifié, trame : PC3 TRJ AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

V A L E U R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	PRIX REVIENT	TOTA	Devise du portefeuille	COURON	COURU	TOTA	PLUS OU MOINS VAL	PRCT
	VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR.	COURS	COTA	VALEUR	F		VALEUR BOURSEIERE	COURON	COURU	TOTA		ACT NET

OPTIONS SUR INDICES - MARCHÉ RÉGLEMENTÉ

Sous-Jacents : SXSE EURO STOXX 50																
OTNL00001V3	EURO S 260320	P5400	125.	P	EUR	129.1	M 31/12/25	42.3	5	161,375.00	52,675.00	0.00			-108,500.00	0.03
OTNL00001205	EURO S 260619	C5650	170.	P	EUR	259.5	M 30/12/25	310.2	4	441,150.00	527,340.00	0.00			86,190.00	0.35
OTNL00001206	EURO S 260619	P5650	170.	P	EUR	312.2	M 30/12/25	179.3	4	530,740.00	304,810.00	0.00			-225,930.00	0.20
Sous TOTAL Sous-Jacents : SXSE EURO STOXX 50										CUMUL (EUR)						
										1,133,265.00						

VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHÉS A TERME

CUMUL (EUR)

1,133,265.00

955,437.65

0.00

-177,827.35

0.63

VII - AUTRES ENGAGEMENTS
AUTRES ENGAGEMENTS

CFD

Sous-Jacents : DE0005552004 DEUTSCHE POST AG NAMEN

CFD58330Z	MS DHL GRUP	1230	-16,110.	EUR	47.1	M 30/12/25	46.73	4	0.00		5,960.70	0.00			5,960.70	0.00
-----------	-------------	------	----------	-----	------	------------	-------	---	------	--	----------	------	--	--	----------	------

CFDA1330Z	MS FRESNELUS	1230	-11,570.	EUR	39.97	M 30/12/25	40.76	4	0.00		-9,140.30	0.00			-9,140.30	-0.01
-----------	--------------	------	----------	-----	-------	------------	-------	---	------	--	-----------	------	--	--	-----------	-------

CFDR930Z	MS DEUTSCHE L	1230	-152,486.	EUR	8.512	M 30/12/25	8.406	4	0.00		16,163.52	0.00			16,163.52	0.01
----------	---------------	------	-----------	-----	-------	------------	-------	---	------	--	-----------	------	--	--	-----------	------

CFDJ2330Z	CFD MSF TEG	EUR 1230	-87,630.	EUR	13.09	M 30/12/25	13.23	4	0.00		-12,268.20	0.00			-12,268.20	-0.01
-----------	-------------	----------	----------	-----	-------	------------	-------	---	------	--	------------	------	--	--	------------	-------

CFD83330Z	MS NORDEX SE	1230	-27,920.	EUR	29.54	M 30/12/25	29.12	4	0.00		11,726.40	0.00			11,726.40	0.01
-----------	--------------	------	----------	-----	-------	------------	-------	---	------	--	-----------	------	--	--	-----------	------

CFDS2930Z	CFD MS MTU AERO	1230	-2,710.	EUR	355.2	M 30/12/25	355.3	4	0.00		-271.00	0.00			-271.00	0.00
-----------	-----------------	------	---------	-----	-------	------------	-------	---	------	--	---------	------	--	--	---------	------

CFDB0030Z	MS EVONIK IND	1230	-40,295.	EUR	13.14	M 30/12/25	13.36	4	0.00		-8,864.90	0.00			-8,864.90	-0.01
-----------	---------------	------	----------	-----	-------	------------	-------	---	------	--	-----------	------	--	--	-----------	-------

CFDB0E30Z	MS LEG IMMOBI	1230	-885.	EUR	60.55	M 30/12/25	62.25	4	0.00		-1,504.50	0.00			-1,504.50	0.00
-----------	---------------	------	-------	-----	-------	------------	-------	---	------	--	-----------	------	--	--	-----------	------

CFDZCL30Z	MS IBERDROLA	1230	-265,845.	EUR	18.1194	M 31/12/25	18.465	4	0.00		-91,884.46	0.00			-91,884.46	-0.06
-----------	--------------	------	-----------	-----	---------	------------	--------	---	------	--	------------	------	--	--	------------	-------

CFDBX630Z	MS INTL CONSO	1230	-232,920.	GBP	4.15	M 31/12/25	4.143	4	0.00		1,867.31	0.00			1,867.31	0.00
-----------	---------------	------	-----------	-----	------	------------	-------	---	------	--	----------	------	--	--	----------	------

CFDB0F30Z	MS ACCOR SA	1230	-9,080.	EUR	47.1007	M 31/12/25	48.22	4	0.00		-10,163.20	0.00			-10,163.20	-0.01
-----------	-------------	------	---------	-----	---------	------------	-------	---	------	--	------------	------	--	--	------------	-------

Stock : Stock admi principal au 31/12/25
PORTFEUILLE : 00050X LBPAM ISR ABSOLUTE RETURN CONVERTIBLES

VL VALDEE

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

(Etat simplifié, trame : PC3 TRJ AMF/TYPE 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. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille		PRCT	
									<-----> PRUX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE		COUPON COURU
SOUS-JACENT : FR0000121485 KERING												
CFDJUN30Z	MS KERING 1230		-731.	EUR	304.05	M 31/12/25	301.	4	0.00	2,229.55	0.00	2,229.55 0.00
SOUS-JACENT : FR0000121972 SCHNEIDER ELECTRIC SE												
CFDMAR30Z	MS SCHNEIDER 1230		-3,200.	EUR	242.7	M 31/12/25	234.9	4	0.00	24,960.00	0.00	24,960.00 0.02
SOUS-JACENT : FR0012435121 ELIS SA												
CFDMAR30Z	MS ELIS SA 1230		-20,830.	EUR	23.62	M 31/12/25	24.26	4	0.00	-13,331.20	0.00	-13,331.20 -0.01
SOUS-JACENT : FR001400J770 AIR FRANCE-KLM												
CFDBQ30Z	MS AIR FRANCE 1230		-25,515.	EUR	11.3433	M 31/12/25	11.565	4	0.00	-5,655.50	0.00	-5,655.50 0.00
SOUS-JACENT : IT0005495657 SAPEM SPA												
CFD38830Z	CFD MS SAPEM S 1230		-367,408.	EUR	2.329	M 30/12/25	2.425	4	0.00	-35,271.17	0.00	-35,271.17 -0.02
SOUS-JACENT : NL0000226223 STMICROELECTRONICS NV												
CFDDEW30Z	MS STMICROELECTRONIC		-30,560.	EUR	22.465	M 30/12/25	22.475	4	0.00	-305.60	0.00	-305.60 0.00
SOUS-JACENT : NL0000235190 AIRBUS SE												
CFDA430Z	MS AIRBUS SE 1230		-1,133.	EUR	196.12	M 31/12/25	198.4	4	0.00	-2,583.24	0.00	-2,583.24 0.00
SOUS-JACENT : NL0006294274 EURONEXT NV												
CFDME730Z	CFD MS EURONEXT 1230		-1,020.	EUR	124.1	M 31/12/25	128.	4	0.00	-3,978.00	0.00	-3,978.00 0.00
SOUS-JACENT : NL0010273215 ASML HOLDING NV												
CFDZCS30Z	CFD MS ASML HOL 1230		-1,350.	EUR	931.	M 31/12/25	921.4	4	0.00	12,960.00	0.00	12,960.00 0.01
SOUS-JACENT : NL0011585146 FERRARI NV												
CFDGLV30Z	CFD MS FERRARI 1230		-590.	EUR	314.	M 30/12/25	318.7	4	0.00	-2,773.00	0.00	-2,773.00 0.00
SOUS-JACENT : NL0012866412 BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES												
CFD9ZD30Z	MS BE SEMICONDU 1230		-7,835.	EUR	132.45	M 31/12/25	133.75	4	0.00	-10,185.50	0.00	-10,185.50 -0.01
SOUS-JACENT : NL0015001F58 FERROVAL SE												
CFD3V630Z	CFD MS FERROVAL 1230		-200.	EUR	57.1171	M 31/12/25	55.34	4	0.00	355.43	0.00	355.43 0.00
SOUS-JACENT : NL0015002CX3 QIAGEN N.V.												
CFDAK230Z	MS QIAGEN N.V 1230		-19,750.	EUR	38.335	M 30/12/25	38.855	4	0.00	-10,270.00	0.00	-10,270.00 -0.01
SOUS-JACENT : US01609W1027 ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR												
CFDAJ330Z	MS ALIBABA GR 1230		-8,550.	USD	150.09	M 31/12/25	146.58	4	0.00	25,552.81	0.00	25,552.81 0.02
SOUS-JACENT : US19260Q1076 COINBASE GLOBAL INC -CLASS A												
CFDBW130Z	CFD MS COINBASE 1230		-2,235.	USD	250.42	M 31/12/25	226.14	4	0.00	46,205.29	0.00	46,205.29 0.03

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 31/12/25
Devise de fixing : FRF Devises Reuters
Devise du portefeuille : EUR
(Etat simplifié, trame : PC3 TRF AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BAL04)

V A L E U R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	Devise du portefeuille			PRCT	
	VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F	PRIX REVENIR	TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL ACT NET

CFD CUMUL (EUR) 0.00 -70,468.76 0.00 -70,468.76 -0.05

IX - TRESORERIE
DETTES ET CREANCES
REGLEMENTS DIFFERES

DEVISE VALEUR : EUR EURO

IPRCIEUR Indemnité Pret diff 1,502.46 EUR 1. 31/12/25 1. 1,502.46 1,502.46 0.00 0.00 0.00 1.38

VRDEUR Vte mlt différé 2,099,494.4 EUR 1. 31/12/25 1. 2,099,494.40 2,099,494.40 0.00 0.00 0.00 1.38

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO CUMUL (EUR)

COLLATERAL CASH SUR DERIVES LISTES

DEVISE VALEUR : EUR EURO

DOMCIEUR Dépôt gar. CACEIS BK 341,826.76 EUR 1. 31/12/25 1. 341,826.76 341,826.76 0.00 0.00 0.00 0.23

COLLATERAL CASH OTC

DEVISE VALEUR : EUR EURO

639BE4335+00 COLLAT JEFF -20,000. EUR 1. 31/12/25 1. -20,000.00 -20,032.16 -32.16 -32.16 -0.01

COLLATERAL CASH SUR PRETEMPRUNT

DEVISE VALEUR : EUR EURO

568BE4335+00 COLCASH568BE4335+00 0. EUR 0. 31/12/25 1. 107.21 107.21 0.00 0.00 0.00 0.00

577BE4335+00 COLCASH577BE4335+00 -0.41 EUR 1. 31/12/25 1. -0.41 -0.41 0.00 0.00 0.00 0.00

585BE4335+00 COLCASH585BE4335+00 -544,000. EUR 1. 31/12/25 1. -544,528.02 -528.02 -528.02 -528.02 -0.36

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO CUMUL (EUR)

APPELS DE MARGE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

MARCEUR Appel Marge CACEIS 20,055. EUR 1. 31/12/25 1. 20,055.00 20,055.00 0.00 0.00 0.00 0.01

DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING

MARCEGBP Appel Marge CACEIS 4,712.49 GBP 1. 31/12/25 1. 1,452,785.9 5,398.82 5,397.11 -1.71 0.00

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

MARCEUSD Appel Marge CACEIS -111,825. USD 0.85111871 31/12/25 0.85146239 -95,176.35 -95,214.78 -38.43 -0.06

APPELS DE MARGE

CUMUL (EUR)

-69,722.53 -69,762.67 0.00 -40.14 -0.05

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 31/12/25
PORTFEBLILLE : 00050X LBPAM ISR ABSOLUTE RETURN CONVERTIBLES VL VALIDEE
Devise de fixing : FRF Devises Reuters
Devise du portefeuille : EUR
(Etat simplifié, trame : PC3 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BAL04)

V A L E U R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	Devise du portefeuille	PRCT
	VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F	VALEUR BOURSIERE	ACT NET

FRAIS DE GESTION

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FCAMEUR	Prov cotisation AMF	-1,394.68	EUR	1.	31/12/25	1.	-1,394.68	0.00	0.00	0.00
FCVFCEUR	Frais de Cest. Fixe	-22,273.54	EUR	1.	31/12/25	1.	-22,273.54	0.00	0.00	-0.01
FCVFD3EUR	Frais de Cest. Fixe	-43,464.23	EUR	1.	31/12/25	1.	-43,464.23	0.00	0.00	-0.03

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

-67,132.45

0.00

0.00 -0.04

AUTRES DETTES ET CREANCES

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FRECEUR	Frais des recherche	-5,057.19	EUR	1.	31/12/25	1.	-5,057.19	0.00	0.00	0.00
FTAPEUR	Frais trans. à payer	15,929.87	EUR	1.	31/12/25	1.	15,929.87	0.00	0.00	0.01
PROEUR	Provision Dividende	-3,180.34	EUR	1.	31/12/25	1.	-3,180.34	0.00	0.00	0.00
ROEUR	Commission sur prêt	-15,265.24	EUR	1.	31/12/25	1.	-15,265.24	0.00	0.00	-0.01

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

-7,572.90

0.00

0.00

DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING

FTACGBP	Frais trans. à payer	1,762.84	GBP	1.14405164	31/12/25	1.14527859	2,016.78	0.00	2,018.94	0.00
---------	----------------------	----------	-----	------------	----------	------------	----------	------	----------	------

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

FTARUSD	Frais trans. à payer	3,159.34	USD	0.85105433	31/12/25	0.85146239	2,688.77	0.00	2,690.06	0.00
---------	----------------------	----------	-----	------------	----------	------------	----------	------	----------	------

AUTRES DETTES ET CREANCES

CUMUL (EUR)

-2,867.35

0.00

3.45

DETTES ET CREANCES

CUMUL (EUR)

1,739,100.88

-452.97

1,738,611.22

DISPONIBILITES

AVOIRS

DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE

BQCHCHF	CACEIS Bank	7,324.83	CHF	1.04860045	31/12/25	1.07469103	7,680.82	0.00	7,871.93	0.01
---------	-------------	----------	-----	------------	----------	------------	----------	------	----------	------

DEVISE VALEUR : EUR EURO

BQCEUR	CACEIS Bank	4,814,639.69	EUR	1.	31/12/25	1.	4,814,639.69	0.00	0.00	3.17
--------	-------------	--------------	-----	----	----------	----	--------------	------	------	------

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

4,815,562.24

0.00

0.00 3.17

DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING

BQICGBP	CACEIS Bank	-142,898.93	GBP	1.14551858	31/12/25	1.14527859	-163,693.38	0.00	-163,659.08	-0.11
---------	-------------	-------------	-----	------------	----------	------------	-------------	------	-------------	-------

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

BQCIUSD	CACEIS Bank	98,783.34	USD	0.85109483	31/12/25	0.85146239	84,073.99	0.00	84,110.30	0.06
---------	-------------	-----------	-----	------------	----------	------------	-----------	------	-----------	------

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

CUMUL (EUR)

86,702.49

0.00

86,743.06

CUMUL (EUR)

86,702.49

0.00

40.57 0.06

CACEIS
OLISFA 1e 02/01/26 23:18:09

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock adm principal au 31/12/25
Devise de fixing : FRF Devises Reuters
Devise du portefeuille : EUR
(Etat simplifie, trame : PC3 TRI AMF/TYRE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

Portfeuille : 0005CX LBPAM ISR ABSOLUTE RETURN CONVERTIBLES

VL VALDEE

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 BOURSEIERE	COURON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
AVOIRS													
CUMUL (EUR)							4,746,252.17		4,746,518.15		0.00	265.98	3.13
IX - TRESORERIE							CUMUL (EUR)		6,485,353.05		6,485,129.37	-452.97	-223.68 4.27
PORTEFEUILLE : LBPAM ISR ABSOLUTE RETURN CONVERTIBLES (0005CX)							(EUR)		144,356,914.41		151,841,836.44	400,049.66	7,484,922.03 100.00

Portefeuille titres :										145,356,707.07		
<u>Frais de gestion du jour</u>												
Prov cotisation AMF :										3.91		EUR
Frais de Gest. Fixe :										675.56		EUR
Frais de Gest. Fixe :										1,318.02		EUR
Frais des recherches :										84.64		EUR
<u>Frais de gestion charge Entreprise</u>												
Frais maximum notice :										1,863.62		EUR
Frais maximum notice :										1,464.47		EUR
Part	Devise	Actif net	Nombre de parts		Valeur liquidative		Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat	
C2	FR0013403771 LBPAM ISR ABS RE C X EUR	85,026,802.04	7,455,27297		11,404.92		55.99662883534			12,089.21	11,404.92	
D3	FR0013403755 LBPAM ISR ABS RE C I EUR	66,815,034.40	602,811.		110.83		44.003337116466			110.83	110.83	
Actif net total en EUR :		151,841,836.44										
Precedente VL en date du 30/12/25 :												
C2	LBPAM ISR ABS RE C X	Prec. VL :		11,405.19		(EUR)		Variation :	-0.002%			
D3	LBPAM ISR ABS RE C I	Prec. VL :		110.84		(EUR)		Variation :	-0.009%			
<u>VL theorique</u>												
Part	Devise	Actif theorique	Valeur liquidative theorique									
C2	FR0013403771 LBPAM ISR ABS RE C X	EUR	85,026,802.04	11,404.92								
D3	FR0013403755 LBPAM ISR ABS RE C I	EUR	66,815,034.40	110.83								
Actif theorique total en EUR :		151,841,836.44 (Sens collecte : EQU)										

Inventaire sur historique de valorisation (HISIMV)



Devise de fixing : FXR Devises Reuters

VL VALIDEE

(Etat simplifié, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)
