



Composition de l'actif

au 31 décembre 2025

SYSTEMATIC EQUITY OVERLAY

Part **C**

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

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			6 871 301,73	88,54
OPCVM			6 871 301,73	88,54
Gestion collective			6 871 301,73	88,54
Ofi Invest ESG Monétaire IC	EUR	13	1 429 920,44	18,42
OSTRUM SRI CASH Part M	EUR	102,50196	1 105 882,37	14,25
OSTRUM SRI CASH PLUS I	EUR	13,0033	1 444 526,06	18,61
OSTRUM SRI MONEY 6M PART E	EUR	128	1 438 698,24	18,54
OSTRUM SRI MONEY Part I-C	EUR	107	1 452 274,62	18,72
TOTAL			6 871 301,73	88,54

(*) 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				
EURO STOXX 50 12/2026 PUT 6000	105	464 100,00	0,00	-3 332 377,31
S&P 500 INDEX 12/2026 PUT 6500	35	422 431,78	0,00	-3 104 493,59
Sous-total 2.		886 531,78	0,00	-6 436 870,90
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
TOTAL		886 531,78	0,00	-6 436 870,90

(*) 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)	6 871 301,73
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	886 531,78
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 (+)	5 523,85
Autres passifs (-)	-2 421,85
Passifs de financement (-)	0,00
TOTAL = ACTIF NET	7 760 935,51

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part SYSTEMATIC EQUITY OVERLAY C	EUR	1 512,00000	5 132,89

Stock : Stock admn principal au 31/12/25
PORTEFEUILLE : 000TQO SYSTEMATI EQ OVERLAY

VL VALIDEE

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

(Etat simplifie, trame : PC3 TRJ AMF/TYRE 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	Devise du portefeuille	COURON	COURU	TOTA	PLUS OU MOINS VAL	ACT NET
	VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR.	COURS	COTA	VALEUR	F		VALEUR BOURSIERE					

III - TITRES D OPC

OPCVM ET EQUIVALENTS D AUTRES ETATS MEMBRE DE L UE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0010392951	OSTRUM SRI CASH M	102.50196	P EUR	10667.1792	M 01/01/26	10788.89	5	1.093.406.78	1.105.882.37	0.00	12.475.59	14.25
FR0010831693	OSTRUM SRI CAS PLU I	13.0033	P EUR	101198.7565	M 01/01/26	111089.19	5	1.315.917.79	1.444.526.06	0.00	128.608.27	18.61
FR0007075122	OSTRUM SRI MONEY IC	107.	P EUR	12332.8083	M 01/01/26	13572.66	5	1.319.610.49	1.452.274.62	0.00	132.664.13	18.71
FR0010799007	OSTRUM SRI MON E	128.	P EUR	10219.9559	M 01/01/26	11239.83	5	1.308.154.35	1.438.698.24	0.00	130.543.89	18.54
FR0013812227	Off Invest ESG Monet	13.	P EUR	109838.78	M 01/01/26	109993.88	0	1.427.904.14	1.429.920.44	0.00	2.016.30	18.42
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO								6,464,993.55	6,871,301.73	0.00	406,308.18	88.54

VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME

ENGAGEMENTS A TERME CONDITIONNELS

OPTIONS SUR INDICES - MARCHÉ REGLEMENTE

SOUS-JACENT : SXSE EURO STOXX 50

02NL000012XG

EURO S 261218 P6500

OPTIONS SUR FUTURES - MARCHÉ REGLEMENTE

SOUS-JACENT : SPX S&P 500 INDEX

0FLU000000DJ

SP 500 261218 P6500

ENGAGEMENTS A TERME CONDITIONNELS

CUMUL (EUR)

1,001,736.19

886,531.78

0.00

-115,204.41 11.42

IX - TRESORERIE

DETTES ET CREANCES

FRAIS DE GESTION

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FCAMFEUR

Prov cotisation AMF

FCPVCFEUR

Frais de Gest. Fixe

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

-2,274.11

-2,274.11

0.00

0.00 -0.03

DISPONIBILITES

AVOIRS

DEVISE VALEUR : EUR EURO

BQCEUR

CACEIS Bank

BQCIUSD

CACEIS Bank

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

BQCIUSD

CACEIS Bank

-173.51

USD

0.85897066

31/12/25

0.85146239

-149.04

-147.74

0.00

1.30 0.00

V A L E U R		STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	<----->		Devise du portefeuille	COURON	COURU	TOTA	PLUS OU MOINS VAL	PRCT
		VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F	PRUX REVIENT	TOTA	VALEUR BOURSEIERE					ACT NET
AVOIRS																	
								CUMUL (EUR)		5,374.81		5,376.11		0.00		1.30	0.07
IX - TRESORERIE								CUMUL (EUR)		3,100.70		3,102.00		0.00		1.30	0.04
PORTFEUILLE : SYSTEMATI EQ OVERLAY (000TQO)								(EUR)		7,469,830.44		7,760,935.51		0.00		291,105.07	100.00

Portefeuille titres :		7,757,833.51							
<u>Frais de gestion du jour</u>									
Prov cotisation AMF :		0.2	EUR						
Frais de Gest. Fixe :		65.92	EUR						
<u>Frais de gestion charge Entreprise</u>									
Frais maximum notice :		106.32	EUR						
Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
CL FR0013439981 SYSTEMATI EQTY OVE C EUR		7,760,935.51	1,512.	5,132.89	100.			5,440.86	5,132.89
Actif net total en EUR :		7,760,935.51							
Precedente VL en date du 30/12/25 :									
CL	SYSTEMATI EQTY OVE C		Prec. VL :	5,117.26	(EUR)	Variation :	+0.305%		

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tri's : BVAL04)

Inventaire sur historique de valorisation (HISIMV)

COURS DES DEVISES UTILISEES				
	par la valorisation	par l'inventaire	par la valorisation précédente	variation
Cours EIR en USD :	1.17445	cotation : 31/12/25	0.	
			1.17585	cotation : 30/12/25
				-0.11906

COURS INVERSES DES DEVISES UTILISEES			
	par l'a valorisation	par l'inventaire	par l'a valorisation précédente
Cours USD en EUR :	0.8514623866	cotation : 31/12/25	0.
			0.8504486116
			cotation : 30/12/25