

## LBPAM ISR PROTECT 80-85 MAI 2028 R

RAPPORT ANNUEL EXTRA FINANCIER AU 28 JUIN 2024

## Stratégie d'investissement

L'objectif de gestion du FCP est triple : i. offrir à chaque date de valeur liquidative une protection partielle en capital (hors frais de souscription et fiscalité) à hauteur de la Valeur Liquidative Protégée correspondant au maximum entre a) 80% de la plus haute valeur liquidative constatée depuis la création du FCP et b) 85% de la première valeur liquidative publiée par le FCP (ci-après la « Valeur Liquidative Initiale »); le maximum entre a) et b) étant défini comme la « Valeur Liquidative Protégée »; ii. offrir une allocation entre un panier d'Actifs Dynamiques, moteur de performance, et un panier d'Actifs Sécurisés permettant d'assurer la Protection; et iii. mettre en œuvre une stratégie d'investissement socialement responsable (ISR). La « Période de Souscription » correspond à la période comprise entre la date de création du FCP et le mardi 16 mai 2023, étant précisé que la Société de Gestion peut clore de façon anticipée cette période, notamment si le nombre maximal de parts (3.000.000,00) a été souscrit. Il est précisé que les souscriptions ne sont pas autorisées en dehors de la Période de Souscription. L'attention des porteurs de parts est attirée sur le fait que le FCP sera également fermé à toute souscription pendant les phases de Monétarisation Temporaire et de Monétarisation Définitive.

## Caractéristiques du FCP

|                                                             |                                     |
|-------------------------------------------------------------|-------------------------------------|
| Date de création de l'OPC                                   | 24/01/2023                          |
| Durée minimale de placement recommandée                     | > 5 ans                             |
| Classification AMF                                          | Garanti ou assorti d'une protection |
| Société de gestion                                          | LBPAM                               |
| Dépositaire                                                 | CACEIS Bank                         |
| Eligible au PEA                                             | Non                                 |
| <strong>Valorisation</strong>                               |                                     |
| Fréquence de valorisation                                   | Quotidienne                         |
| Nature de la valorisation                                   | Cours de clôture                    |
| Lieu de publication de la VL                                | www.lbpam.com                       |
| Valorisateur                                                | CACEIS Fund Administration          |
| <strong>Souscriptions-rachats</strong>                      |                                     |
| Heure limite de centralisation auprès du dépositaire        | 13h00                               |
| Heure limite de passage d'ordre auprès de La Banque Postale | 12h15                               |
| Ordre effectué à                                            | Cours Inconnu                       |
| Règlement / Livraison                                       | J+2                                 |



En savoir +

## Approche extra-financière GREaT



## Gouvernance responsable

Encourager la diffusion des meilleures pratiques en termes de gouvernance d'entreprise et d'éthique des affaires.



## Gestion durable des Ressources

Gérer durablement les ressources humaines ou naturelles : respect des droits de l'Homme, développement du droit du travail, relations durables avec les fournisseurs, protection de l'environnement.



## Transition Énergétique

Maîtriser les risques climatiques en accompagnant le passage d'un modèle économique fortement carboné vers un modèle plus sobre et plus durable.



## Développement des Territoires

Promouvoir des pratiques responsables répondant aux Objectifs de Développement Durables sociaux et créatrices de valeur pour l'ensemble des parties prenantes en lien avec la chaîne de valeur.

## Méthode de sélection dans le cadre du label ISR

## CRITÈRES D'ÉLIGIBILITÉ POUR LES FONDS DE FONDS

Les fonds de fonds doivent être investis au moins à 90% dans des fonds ayant le label ISR.

## Indicateurs clefs de performance ISR

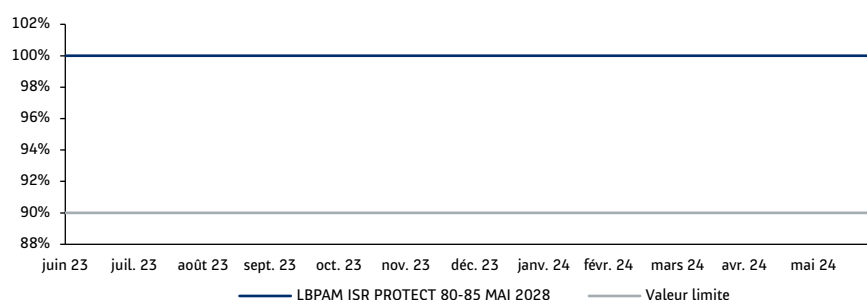
## INDICATEURS ISR

|                      | Valeur du portefeuille | Valeur limite |
|----------------------|------------------------|---------------|
| Score GREaT moyen    | 3,8                    | -             |
| % de fonds labélisés | 100,00%                | 90,00%        |

Score GREaT moyen Moyenne pondérée des scores GREaT des titres en position. La note 1 correspond à la plus forte qualité extra-financière et 10 la plus faible.

## ÉVOLUTION DES INDICATEURS ISR

% de fonds labélisés



DÉTAIL DES FONDS EN POSITIONS

| ISIN du fonds sous-jacent | Libellé du Fonds /Poche sous-jacent | Classe d'actif | Label ISR | Méthode de sélectivité ISR | Note ISR du fonds | Note ISR du comparable | % de l'actif net | Lien reporting ISR   |
|---------------------------|-------------------------------------|----------------|-----------|----------------------------|-------------------|------------------------|------------------|----------------------|
| FR0010302711              | LBPAM ISR ACTIONS AMERIQUE E        | Equity         | Oui       | AverageScore               | 4,3               | 4,4                    | 13,31%           | <a href="#">Lien</a> |
| FR0013239407              | LBPAM ISR ACTIONS USA 500 R         | Equity         | Oui       | AverageScore               | 4,3               | 4,4                    | 13,29%           | <a href="#">Lien</a> |
| FR0010831693              | OSTRUM SRI CASH PLUS I C EUR        | Money Market   | Oui       | -                          | -                 | -                      | 9,47%            | <a href="#">Lien</a> |
| FR0011427632              | LBPAM ISR ACTIONS EX-EURO I         | Equity         | Oui       | AverageScore               | 4,2               | 4,2                    | 8,76%            | <a href="#">Lien</a> |
| FR0013323102              | LBPAM ISR ACTIONS ASIE M            | Equity         | Oui       | AverageScore               | 3,7               | 3,7                    | 8,44%            | <a href="#">Lien</a> |
| FR0010600247              | TOCQUEVILLE SMALL CAP EURO ISR I    | Equity         | Oui       | AverageScore               | 3,8               | 4,0                    | 8,40%            | -                    |
| FR0011525534              | TOCQUEVILLE CROISSANCE EURO ISR I   | Equity         | Oui       | Exclusion                  | 5,1               | 5,4                    | 6,51%            | <a href="#">Lien</a> |
| FR0011524370              | TOCQUEVILLE VALUE EURO ISR I        | Equity         | Oui       | Exclusion                  | 4,9               | 5,0                    | 6,45%            | <a href="#">Lien</a> |
| FR0010892471              | LBPAM ISR ACTIONS JAPON R           | Equity         | Oui       | AverageScore               | 3,9               | 3,9                    | 4,88%            | <a href="#">Lien</a> |
| FR0010914069              | LBPAM ISR ACTIONS FOCUS EURO I      | Equity         | Oui       | AverageScore               | 3,2               | 3,3                    | 4,32%            | <a href="#">Lien</a> |
| FR0010842385              | TOCQUEVILLE EURO EQUITY ISR I       | Equity         | Oui       | Exclusion                  | 5,1               | 5,4                    | 4,30%            | <a href="#">Lien</a> |
| FR0011451947              | TOCQUEVILLE MID CAP EURO ISR I      | Equity         | Oui       | Exclusion                  | 5,3               | 5,7                    | 4,28%            | <a href="#">Lien</a> |
| FR0013330271              | LBPAM ISR ACTIONS EMERGENTS M       | Equity         | Oui       | AverageScore               | 4,1               | 4,4                    | 4,04%            | <a href="#">Lien</a> |
| FR0010392951              | OSTRUM SRI CASH M (C/D) EUR         | Money Market   | Oui       | -                          | -                 | -                      | 3,38%            | <a href="#">Lien</a> |
| FR0013277522              | FEDERIS ISR ACTIONS US I            | Equity         | Oui       | Exclusion                  | 6,1               | 6,4                    | 0,00%            | <a href="#">Lien</a> |

INDICATEURS ISR DES FONDS SOUS-JACENT

| ISIN du fonds sous-jacent | Libellé du Fonds /Poche sous-jacent | % de l'actif net | EMPREINTE CARBONE (Scope 1+2) |            | FORMATION    |            | DROITS HUMAINS SIGNATURE DU PACTE MONDIAL |            | SANTÉ ET SÉCURITÉ |            |
|---------------------------|-------------------------------------|------------------|-------------------------------|------------|--------------|------------|-------------------------------------------|------------|-------------------|------------|
|                           |                                     |                  | Portefeuille                  | Comparable | Portefeuille | Comparable | Portefeuille                              | Comparable | Portefeuille      | Comparable |
| FR0010302711              | LBPAM ISR ACTIONS AMERIQUE E        | 13,31%           | 16,25                         | 32,94      | 26,90        | 24,63      | -                                         | -          | 0,77              | 1,66       |
| FR0013239407              | LBPAM ISR ACTIONS USA 500 R         | 13,29%           | 23,06                         | 32,94      | 26,71        | 24,63      | -                                         | -          | 1,24              | 1,66       |
| FR0011427632              | LBPAM ISR ACTIONS EX-EURO I         | 8,76%            | 41,75                         | 52,88      | 23,44        | 24,48      | -                                         | -          | 1,68              | 1,41       |
| FR0013323102              | LBPAM ISR ACTIONS ASIE M            | 8,44%            | 58,30                         | 65,95      | 22,58        | 23,39      | -                                         | -          | 0,91              | 0,82       |
| FR0010600247              | TOCQUEVILLE SMALL CAP EURO ISR I    | 8,40%            | 90,40                         | 123,99     | 25,82        | 23,72      | -                                         | -          | 4,18              | 4,41       |
| FR0011525534              | TOCQUEVILLE CROISSANCE EURO ISR I   | 6,51%            | 34,96                         | 122,40     | 24,47        | 24,73      | -                                         | -          | 3,20              | 3,26       |
| FR0011524370              | TOCQUEVILLE VALUE EURO ISR I        | 6,45%            | 91,91                         | 122,40     | 32,50        | 24,73      | -                                         | -          | 3,04              | 3,26       |
| FR0010892471              | LBPAM ISR ACTIONS JAPON R           | 4,88%            | 57,22                         | 61,90      | 20,07        | 19,80      | -                                         | -          | 0,58              | 0,49       |
| FR0010914069              | LBPAM ISR ACTIONS FOCUS EURO I      | 4,32%            | 41,00                         | 45,04      | 30,35        | 29,95      | -                                         | -          | 2,47              | 2,86       |
| FR0010842385              | TOCQUEVILLE EURO EQUITY ISR I       | 4,30%            | 64,08                         | 87,59      | 30,69        | 24,11      | -                                         | -          | 2,60              | 2,99       |
| FR0011451947              | TOCQUEVILLE MID CAP EURO ISR I      | 4,28%            | 77,05                         | 123,99     | 20,63        | 23,72      | -                                         | -          | 2,81              | 4,41       |
| FR0013330271              | LBPAM ISR ACTIONS EMERGENTS M       | 4,04%            | 77,32                         | 167,18     | 49,35        | 49,52      | -                                         | -          | 0,75              | 0,72       |
| FR0010392951              | OSTRUM SRI CASH M (C/D) EUR         | 3,38%            | -                             | -          | -            | -          | -                                         | -          | -                 | -          |
| FR0013277522              | FEDERIS ISR ACTIONS US I            | 0,00%            | 9,93                          | 25,20      | 30,88        | 25,27      | -                                         | -          | 1,01              | 1,52       |

INDICATEURS ISR DES FONDS SOUS-JACENT

| ISIN du fonds sous-jacent | Libellé du Fonds /Poche sous-jacent | % de l'actif net | GESTION DE L'EAU |            | TAUX D'INDÉPENDANCE |            | RÉMUNÉRATION RESPONSABLE |            |  |  |
|---------------------------|-------------------------------------|------------------|------------------|------------|---------------------|------------|--------------------------|------------|--|--|
|                           |                                     |                  | Portefeuille     | Comparable | Portefeuille        | Comparable | Portefeuille             | Comparable |  |  |
| FR0010302711              | LBPAM ISR ACTIONS AMERIQUE E        | 13,31%           | 559              | 466        | 56,29%              | 56,08%     | 70,21%                   | 59,55%     |  |  |
| FR0013239407              | LBPAM ISR ACTIONS USA 500 R         | 13,29%           | 551              | 466        | 58,06%              | 56,08%     | 72,36%                   | 59,55%     |  |  |
| FR0011427632              | LBPAM ISR ACTIONS EX-EURO I         | 8,76%            | 628              | 621        | 62,76%              | 62,77%     | 80,86%                   | 79,78%     |  |  |
| FR0013323102              | LBPAM ISR ACTIONS ASIE M            | 8,44%            | 570              | 766        | 54,35%              | 55,34%     | 47,47%                   | 41,64%     |  |  |
| FR0010600247              | TOCQUEVILLE SMALL CAP EURO ISR I    | 8,40%            | 1259             | 1002       | 44,83%              | 50,61%     | 80,49%                   | 74,41%     |  |  |
| FR0011525534              | TOCQUEVILLE CROISSANCE EURO ISR I   | 6,51%            | 523              | 725        | 43,74%              | 52,84%     | 97,50%                   | 84,59%     |  |  |
| FR0011524370              | TOCQUEVILLE VALUE EURO ISR I        | 6,45%            | 349              | 725        | 53,12%              | 52,84%     | 97,96%                   | 84,59%     |  |  |
| FR0010892471              | LBPAM ISR ACTIONS JAPON R           | 4,88%            | 599              | 565        | 37,58%              | 37,64%     | 34,06%                   | 29,35%     |  |  |
| FR0010914069              | LBPAM ISR ACTIONS FOCUS EURO I      | 4,32%            | 389              | 358        | 45,59%              | 46,14%     | 96,15%                   | 98,00%     |  |  |
| FR0010842385              | TOCQUEVILLE EURO EQUITY ISR I       | 4,30%            | 579              | 722        | 52,06%              | 55,45%     | 96,15%                   | 80,24%     |  |  |
| FR0011451947              | TOCQUEVILLE MID CAP EURO ISR I      | 4,28%            | 843              | 1002       | 56,00%              | 50,61%     | 87,50%                   | 74,41%     |  |  |
| FR0013330271              | LBPAM ISR ACTIONS EMERGENTS M       | 4,04%            | 903              | 1039       | 41,88%              | 40,41%     | 36,30%                   | 27,54%     |  |  |
| FR0010392951              | OSTRUM SRI CASH M (C/D) EUR         | 3,38%            | -                | -          | -                   | -          | -                        | -          |  |  |
| FR0013277522              | FEDERIS ISR ACTIONS US I            | 0,00%            | 562              | 437        | 59,56%              | 56,14%     | 71,15%                   | 62,21%     |  |  |