

LBPAM ISR PROTECT 80-85 SEPTEMBRE 2028 R

RAPPORT ANNUEL EXTRA FINANCIER AU 30 SEPTEMBRE 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 19 septembre 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	23/05/2023
Durée minimale de placement recommandée	5 ans
Classification AMF	/if(Garanti ou assorti d'une protection="N/A",Garanti ou assorti d'une protection)
Société de gestion	LBP AM
Dépositaire	CACEIS Bank
Eligible au PEA	Non
Valorisation	
Fréquence de valorisation	Quotidienne
Nature de la valorisation	Cours de clôture
Lieu de publication de la VL	www.lbpam.com
Valorisateur	CACEIS Fund Administration
Souscriptions-rachats	
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

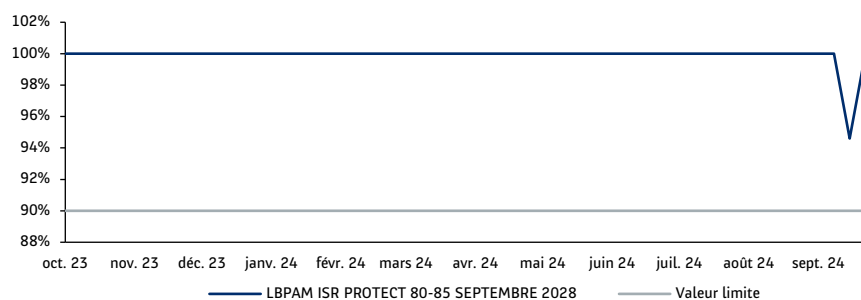
INDICATEURS ISR	Valeur du portefeuille	Valeur limite
Score GREaT moyen	7,2	-
% de fonds labélisés	100,00%	90,00%
Taux de durabilité	47,4%	10,0%

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

Taux de durabilité : Part des entreprises considérées comme des investissements durables au sens de la réglementation SFDR.

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
FR0010842385	TOCQUEVILLE EURO EQUITY ISR I	Equity	Oui	Exclusion	5,9	5,6	10,22%	Lien
FR0010914069	LBPAM ISR ACTIONS FOCUS EURO I	Equity	Oui	AverageScore	7,8	7,7	10,55%	Lien
FR0010302711	LBPAM ISR ACTIONS AMERIQUE E	Equity	Oui	AverageScore	6,8	6,6	9,54%	Lien
FR0013239407	LBPAM ISR ACTIONS USA 500 R	Equity	Oui	AverageScore	6,6	6,6	10,36%	Lien
FR0011525534	TOCQUEVILLE CROISSANCE EURO ISR I	Equity	Oui	Exclusion	6,1	6,0	6,08%	Lien
FR0011524370	TOCQUEVILLE VALUE EURO ISR I	Equity	Oui	Exclusion	6,2	6,0	5,93%	Lien
FR0010600247	TOCQUEVILLE SMALL CAP EURO ISR I	Equity	Oui	AverageScore	7,2	7,0	5,35%	Lien
FR0013277522	FEDERIS ISR ACTIONS US I	Equity	Oui	Exclusion	4,9	4,5	0,00%	Lien
FR0011451947	TOCQUEVILLE MID CAP EURO ISR I	Equity	Oui	Exclusion	5,7	5,3	2,39%	Lien
FR0011427632	LBPAM ISR ACTIONS EX-EURO I	Equity	Oui	AverageScore	6,8	6,8	9,47%	Lien
FR0013330271	LBPAM ISR ACTIONS EMERGENTS M	Equity	Oui	AverageScore	6,8	6,6	5,46%	Lien
FR0013323102	LBPAM ISR ACTIONS ASIE M	Equity	Oui	AverageScore	7,4	7,3	3,24%	Lien
FR001400BM15	LBPAM ISR ACTIONS JAPON I	Equity	Oui	AverageScore	7,2	7,1	1,62%	Lien
FR0007435920	AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM SRI I-C	Money Market	Oui	-	-	-	11,92%	Lien
FR0010956581	AXA COURT TERME ICE	Money Market	Oui	-	-	-	7,79%	Lien

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
FR0010914069	LBPAM ISR ACTIONS FOCUS EURO I	10,55%	40,98	45,63	30,04	29,90	-	-	2,47	2,87
FR0013239407	LBPAM ISR ACTIONS USA 500 R	10,36%	17,22	33,93	24,45	24,20	-	-	1,03	1,71
FR0010842385	TOCQUEVILLE EURO EQUITY ISR I	10,22%	71,31	88,48	29,73	24,20	-	-	3,21	2,91
FR0010302711	LBPAM ISR ACTIONS AMERIQUE E	9,54%	13,03	33,93	24,32	24,20	-	-	0,85	1,71
FR0011427632	LBPAM ISR ACTIONS EX-EURO I	9,47%	41,03	51,09	23,61	24,58	-	-	1,66	1,43
FR0011525534	TOCQUEVILLE CROISSANCE EURO ISR I	6,08%	36,30	126,71	25,98	24,92	-	-	3,27	3,18
FR0011524370	TOCQUEVILLE VALUE EURO ISR I	5,93%	85,10	126,71	32,88	24,92	-	-	3,02	3,18
FR0013330271	LBPAM ISR ACTIONS EMERGENTS M	5,46%	78,63	160,54	49,42	49,43	-	-	0,75	0,72
FR0010600247	TOCQUEVILLE SMALL CAP EURO ISR I	5,35%	87,14	119,11	26,21	23,78	-	-	3,62	4,52
FR0013323102	LBPAM ISR ACTIONS ASIE M	3,24%	59,46	65,15	23,27	23,89	-	-	0,87	0,83
FR0011451947	TOCQUEVILLE MID CAP EURO ISR I	2,39%	71,26	119,11	21,02	23,78	-	-	2,82	4,52
FR001400BM15	LBPAM ISR ACTIONS JAPON I	1,62%	58,04	61,87	21,02	20,39	-	-	0,55	0,50
FR0013277522	FEDERIS ISR ACTIONS US I	0,00%	8,65	24,40	28,27	24,97	-	-	0,89	1,55

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		
FR0010914069	LBPAM ISR ACTIONS FOCUS EURO I	10,55%	387	367	46,07%	46,75%	96,15%	98,00%		
FR0013239407	LBPAM ISR ACTIONS USA 500 R	10,36%	601	467	58,94%	55,85%	68,99%	59,79%		
FR0010842385	TOCQUEVILLE EURO EQUITY ISR I	10,22%	629	698	52,17%	55,28%	97,83%	80,71%		
FR0010302711	LBPAM ISR ACTIONS AMERIQUE E	9,54%	272	467	56,97%	55,85%	65,31%	59,79%		
FR0011427632	LBPAM ISR ACTIONS EX-EURO I	9,47%	623	614	63,07%	63,00%	82,00%	79,78%		
FR0011525534	TOCQUEVILLE CROISSANCE EURO ISR I	6,08%	477	701	45,11%	52,54%	97,44%	85,52%		
FR0011524370	TOCQUEVILLE VALUE EURO ISR I	5,93%	384	701	53,39%	52,54%	100,00%	85,52%		
FR0013330271	LBPAM ISR ACTIONS EMERGENTS M	5,46%	875	993	41,68%	40,13%	37,31%	27,57%		
FR0010600247	TOCQUEVILLE SMALL CAP EURO ISR I	5,35%	1166	984	44,78%	50,41%	87,50%	76,03%		
FR0013323102	LBPAM ISR ACTIONS ASIE M	3,24%	552	766	54,32%	55,68%	48,92%	42,09%		
FR0011451947	TOCQUEVILLE MID CAP EURO ISR I	2,39%	799	984	56,48%	50,41%	90,00%	76,03%		
FR001400BM15	LBPAM ISR ACTIONS JAPON I	1,62%	561	560	37,90%	37,97%	35,20%	29,74%		
FR0013277522	FEDERIS ISR ACTIONS US I	0,00%	284	430	61,03%	56,04%	65,38%	62,40%		