

Rapport semestriel

au 30 septembre 2024

LBPAM ISR OBLI JUIN 2029

Part L, Part I, Part GP, Part RC, Part RD

FORME JURIDIQUE DE L'OPC

FCP de droit français

CLASSIFICATION

Obligations et autres titres de créances internationaux

AFFECTATION DES RÉSULTATS

Le FCP est un OPCVM de capitalisation et/ou de distribution et/ou de report pour les parts I, L, GP et RD et de capitalisation pour la part RC.

La société de gestion décide chaque année de l'affectation des sommes distribuables et de la possibilité de distribuer des acomptes.

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

INFORMATIONS RÉGLEMENTAIRES CONCERNANT L'OPC

Néant

INFORMATIONS RELATIVES AUX CESSIONS ET ACQUISITIONS TEMPORAIRES DE TITRES (CATT) ET INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS DE TYPE CONTRAT D'ÉCHANGE SUR RENDEMENT GLOBAL (TOTAL RETURN SWAP (TRS)):

Informations générales	
Montant des titres prêtés en proportion du total des actifs	_
Montant des titres engagés dans des opérations de prise en pension	_
Montant des titres engagés dans des opérations de mise en pension	22 864 575 euros soit 5,56 % de l'actif net
Données sur la concentration (opérations de mise en pensior	n)
Les 10 plus gros émetteurs de garantie	_
Les 10 principales contreparties pour les opérations de mise en pension	BNPP FRANCE (73,20 %), ODDO ASSET MANAGMENT (24,7 %), JEFFERIES GMBH (2,1 %)
Données sur la concentration (opérations de prise en pension	1)
Les 10 plus gros émetteurs de garantie	_
Les 10 principales contreparties pour les opérations de prise en pension	_
Données d'opération agrégées (opérations de mise en pension	on)
Type, qualité et monnaie des garanties	Collatéral cash Euro issu d'opérations de mise en pension
Échéance des titres sous-jacents	_
Échéance des opérations	1 jour
Pays des contreparties	France (73,20 %), MISSING COUNTRY CODE (24,7 %) ,MISSING COUNTRY CODE (2,1 %)
Règlement et compensation	Bilatéral
Données d'opération agrégées (opérations de prise en pension	on)
Type, qualité et monnaie des garanties	_
Échéance des titres sous-jacents	-
Échéance des opérations	_
Pays des contreparties	_
Règlement et compensation	_
Données sur la réutilisation des garanties	
Part des garanties reçues qui est réutilisée	100 %
Revenus pour l'OPC	0
Conservation des garanties reçues par l'OPC dans le cadre de d'échange sur rendement global	es opérations de financement sur titres et des contrats
Nombre de dépositaires	1
Noms des dépositaires	0
Conservation des garanties fournies par l'OPC dans le cadre d d'échange sur rendement global	des opérations de financement sur titres et des contrats
Part des garanties détenues sur des comptes séparées ou des comptes groupés, ou sur d'autres comptes	100 % des garanties détenues sur un compte dédié au fonds et unique pour toutes les contreparties
Données sur les revenus et les coûts des opérations de prêts	emprunts de titres
Ventilation entre l'OPC, le gestionnaire de l'OPC et les tiers en valeur absolue et en % des revenus globaux générés	OPC : 38 418 euros (67 % des revenus) Gestionnaire de l'OPC : 18 923 euros (33 % des revenus)

ETAT DU PATRIMOINE EN EUR

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique (*)
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	387 248 057,04
b) Avoirs bancaires	69 204,65
c) Autres actifs détenus par l'OPC	49 203 902,06
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	436 521 163,75
e) Passif	-25 110 731,31
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	411 410 432,44

^(*) Les montants sont signés

NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART

Part	Type de part	Actif net de la part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
LBPAM ISR OBLI JUIN 2029 PART RC en EUR	С	411 048 604,94	3 991 431,45861	102,98
LBPAM ISR OBLI JUIN 2029 PART RD en EUR	D	361 827,50	3 513,47711	102,98

ELEMENT DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	80,58	75,95
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	13,54	12,76
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	6,43	6,06

^(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine (**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
Euro	EUR	326 384 096,38	79,33	74,77
Livre Sterling	GBP	30 864 761,43	7,50	7,07
Dollar Us	USD	29 999 199,23	7,29	6,87
TOTAL		387 248 057,04	94,13	88,71

^(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine (**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine



REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR

Pays	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
FRANCE	36,13	34,05
PAYS-BAS	9,48	8,94
ITALIE	8,86	8,35
ETATS-UNIS	8,44	7,95
ESPAGNE	6,99	6,58
ALLEMAGNE	4,13	3,89
BELGIQUE	3,28	3,09
SUEDE	2,76	2,60
LUXEMBOURG	2,55	2,40
DANEMARK	2,34	2,21
ROYAUME-UNI	2,32	2,18
FINLANDE	2,05	1,93
IRLANDE	1,09	1,03
CANADA	0,93	0,88
HONGRIE	0,93	0,87
ILES CAIMANS	0,93	0,87
POLOGNE	0,93	0,88
TOTAL	94,13	88,71

^(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine (**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

REPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	6,43	6,06
Autres OPC et fonds d'investissements	0,00	0,00
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	0,00	0,00
Autres	0,00	0,00
TOTAL	6,43	6,06

^(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine (**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE EN EUR

Elámonto do montofocillo tituas	Mouvements	(en montant)
Eléments du portefeuille titres	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	379 202 517,70	36 597 669,42
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	62 130 558,87	7 594 968,45
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	104 512 934,71	78 375 686,25

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR	Montant éligible à réfaction EUR
Dividendes ve	rsés				
	LBPAM ISR OBLI JUIN 2029 PART RD				
Dividendes à	verser				
	LBPAM ISR OBLI JUIN 2029 PART RD				

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
OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			387 248 057,04	94,13
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			387 248 057,04	94,13
Assurance			13 948 825,15	3,39
ASS GENERALI 3.875% 29-01-29	EUR	5 500 000	5 760 045,26	1,40
CNPFP 2 3/4 02/05/29	EUR	3 700 000	3 691 093,31	0,90
PERMANENT TSB GROUP 6.625% 30-06-29	EUR	4 000 000	4 497 686,58	1,09
Automobiles			11 641 616,85	2,83
General Motors Financial Co Inc 4.3% 15-02-29	EUR	6 000 000	6 349 991,15	1,54
JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE 4.5% 15-07-28	EUR	5 200 000	5 291 625,70	1,29
Banques commerciales			99 646 064,61	24,23
BANCO DE BADELL 5.25% 07-02-29	EUR	3 500 000	3 847 547,70	0,94
BBVA 5.381% 13-03-29	USD	4 400 000	4 107 352,00	1,00
BELFIUS SANV 3.75% 22-01-29	EUR	6 900 000	7 258 072,67	1,76
BNP PAR 1.375% 28-05-29 EMTN	EUR	6 300 000	5 845 040,75	1,42
BPCE 5.25% 16-04-29	GBP	7 900 000	9 638 448,33	2,36
BQ POSTALE 1.375% 24-04-29	EUR	4 800 000	4 448 520,33	1,08
CA 2.0% 25-03-29 EMTN	EUR	8 100 000	7 769 890,60	1,89
CREDIT MUTUEL ARKEA 3.5% 09-02-29	EUR	7 600 000	7 906 191,13	1,92
DEUTSCHE BK PARIS BRANCH 1.875% 22-12-28	GBP	3 800 000	4 200 073,99	1,02
FORD MOTOR CREDIT 5.113% 03-05-29	USD	7 600 000	6 888 860,57	1,67
INTE 6.5% 14-03-29 EMTN	GBP	7 000 000	8 739 311,71	2,12
MONTE PASCHI 4.75% 15-03-29	EUR	1 200 000	1 269 009,04	0,31
MONTE PASCHI EUSA5+5.005% 18-01-28	EUR	2 500 000	2 861 212,70	0,70
NIBC BANK NV 6.0% 16-11-28	EUR	5 500 000	6 325 016,23	1,54
PKO Bank Polski 4.5% 18-06-29	EUR	3 700 000	3 839 817,42	0,93
RCI BANQUE 3.875% 12-01-29	EUR	8 300 000	8 642 547,80	2,10
SG 0.5% 12-06-29	EUR	3 300 000	2 977 835,01	0,72
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 5.375% 05-03-29	USD	3 300 000	3 081 316,63	0,75
Compagnies aériennes			8 118 600,06	1,97
AIR FR KLM 4.625% 23-05-29	EUR	3 500 000	3 628 541,10	0,88
FINNAIR 4.75% 24-05-29	EUR	4 400 000	4 490 058,96	1,09
Composants automobiles			20 378 968,22	4,95
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 4.875% 13-03-29	EUR	6 000 000	6 153 138,08	1,50
FORVIA 2.375% 15-06-29	EUR	9 100 000	8 179 253,15	1,98
VALEO 5.875% 12-04-29 EMTN	EUR	5 600 000	6 046 576,99	1,47
Construction et ingénierie			5 033 574,58	1,22
HOCHTIEF AG 0.625% 26-04-29	EUR	5 600 000	5 033 574,58	1,22
Distribution de produits alimentaires de première nécessité	LOIX	3 000 000	97 820,03	0,02
·	ELID	100,000	•	
WORLDLINE 4.125% 12-09-28 EMTN	EUR	100 000	97 820,03	0,02
Eau			3 490 335,89	0,85
HIME SARLU 0.625% 16-09-28	EUR	4 000 000	3 490 335,89	0,85
Emballage et conditionnement			7 429 096,88	1,81
BALL 6.0% 15-06-29	USD	3 700 000	3 482 386,09	0,85
HUHTAMAKI OYJ 5.125% 24-11-28	EUR	3 600 000	3 946 710,79	0,96
Epargne et prêts hypothécaires			5 700 821,81	1,39
CROWN EU HLD 4.75% 15-03-29	EUR	5 500 000	5 700 821,81	1,39
Equipements électriques			6 183 538,36	1,50
NEXANS 4.125% 29-05-29	EUR	6 000 000	6 183 538,36	1,50

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Equipements et instruments électroniques			4 002 072,67	0,97
ENERGIZER GAMMA ACQ 3.5% 30-06-29	EUR	4 200 000	4 002 072,67	0,97
FPI de détail			12 496 489,96	3,04
CARMILA 1.625% 01-04-29 EMTN	EUR	6 300 000	5 873 123,22	1,43
MERCIALYS 2.5% 28-02-29	EUR	6 800 000	6 623 366,74	1,61
Industrie aérospatiale et défense			3 839 469,56	0,93
BOMBARDIER 7.5% 01-02-29	USD	4 000 000	3 839 469,56	0,93
Infrastructure de transports			14 727 364,24	3,58
ABERTIS INFRA 2.25% 29-03-29	EUR	3 000 000	2 932 882.19	0,71
ATLANTIA EX AUTOSTRADE 4.75% 24-01-29	EUR	5 500 000	5 884 147,05	1,43
AUTOSTRADE PER L ITALILIA 2.0% 04-12-28	EUR	6 100 000	5 910 335,00	1,44
Logiciels			13 129 410,75	3,19
CONSTELLIUM SE 3.75% 15-04-29	USD	6 500 000	5 545 554,26	1,34
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 3.75% 25-03-29	EUR	100 000	103 107,33	0,03
NEXI 2.125% 30-04-29	EUR	2 300 000	2 167 479,11	0,53
TELEFON AB LM ERICSSON 1.0% 26-05-29	EUR	5 900 000	5 313 270,05	1,29
Marches de capitaux			34 803 642,76	8,46
BANCO SANTANDER ALL SPAIN BRANCH 3.875% 22-04-29	EUR	7 500 000	7 834 385.96	1,90
BK LC LUX FINCO1 SARL 5.25% 30-04-29	EUR	3 000 000	3 112 070,00	0,76
JEFFERIES FINANCIAL GROUP 4.0% 16-04-29	EUR	5 700 000	5 939 973,12	1,44
OTP BANK 5.0% 31-01-29 EMTN	EUR	3 600 000	3 817 115,80	0,93
PHOENIX GROUP 4.375% 24-01-29	EUR	4 000 000	4 237 651,80	1,03
QPARK HOLDING I BV 5.125% 01-03-29	EUR	3 800 000	3 932 729,49	0,96
TELENET FINANCE LUX NOTE 3.5% 01-03-28	EUR	3 000 000	2 979 070,76	0,72
VERISURE HOLDING AB 7.125% 01-02-28	EUR	2 800 000	2 950 645,83	0,72
Matériaux de construction			3 714 017,12	0,90
SPCM 2.625% 01-02-29	EUR	3 900 000	3 714 017,12	0,90
Outils et services appliqués aux sciences biologiques			5 637 795,00	1,37
IQVIA 2.25% 15-03-29	EUR	6 000 000	5 637 795,00	1,37
Papier et industrie du bois			3 622 877,80	0,88
PROGROUP AG 5.125% 15-04-29	EUR	3 600 000	3 622 877,80	0,88
Produits alimentaires			4 921 304,97	1,20
BEL 4.375% 11-04-29	EUR	4 700 000	4 921 304,97	1,20
Produits chimiques	Lort	4700000	4 123 184,11	1,00
KS AKTUELL AG 4.25% 19-06-29	EUR	4 000 000	4 123 184,11	1,00
	LOIX	4 000 000		
Services aux collectivités	LIOD	0.000.000	1 896 810,18	0,46
ENGIE 5.25% 10-04-29	USD	2 000 000	1 896 810,18	0,46
Services aux entreprises	EUD	0.500.000	3 790 853,89	0,92
BANIJAY ENTERTAINMENT SASU 7.0% 01-05-29	EUR	3 500 000	3 790 853,89	0,92
Services clientèle divers			8 353 956,22	2,03
BOELS TOPHOLDING BV 6.25% 15-02-29	EUR	4 500 000	4 710 688,75	1,14
ISS GLOBAL AS 3.875% 05-06-29	EUR	3 500 000	3 643 267,47	0,89
Services de télécommunication diversifiés			15 550 745,13	3,78
CELLNEX TELECOM 1.875% 26-06-29	EUR	5 200 000	4 929 518,08	1,20
ILIAD 5.375% 15-02-29	EUR	2 000 000	2 179 834,92	0,53
ILIAD HOLDING SAS 5.625% 15-10-28	EUR	1 900 000	1 983 892,13	0,48
TDF INFRASTRUCTURE SAS 5.625% 21-07-28	EUR	6 000 000	6 457 500,00	1,57
Services de télécommunication mobile			5 262 527,51	1,28
AMERICAN TOWER 0.875% 21-05-29	EUR	5 800 000	5 262 527,51	1,28
Services financiers diversifiés			39 977 770,29	9,72
ARGENTA SPAARBANK 1.375% 08-02-29	EUR	6 600 000	6 237 486,34	1,52
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 1.875% 18-06-29	EUR	6 600 000	6 188 260,36	1,50
GROUPE DES ASSURANCES CREDIT MUTUEL 3.75% 30-04-29	EUR	1 200 000	1 243 397,59	0,30

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
MOBILUX FINANCE SAS 4.25% 15-07-28	EUR	4 100 000	3 925 136,14	0,95
SHIBA BID 4.5% 31-10-28	EUR	3 900 000	3 850 587,00	0,94
TRATON FINANCE LUXEMBOURG 5.625% 16-01-29	GBP	3 500 000	4 393 283,53	1,07
UPCB FINANCE VII 3.625% 15-06-29	EUR	3 900 000	3 811 054,54	0,93
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 5.875% 23-05-29	GBP	3 100 000	3 893 643,87	0,95
ZF EUROPE FINANCE BV 6.125% 13-03-29	EUR	6 100 000	6 434 920,92	1,56
SIIC spécialisées dans le crédit hypothécaire			5 991 898,51	1,46
NYKREDIT 4.625% 19-01-29 EMTN	EUR	5 500 000	5 991 898,51	1,46
Sociétés commerciales et de distribution			6 612 359,01	1,61
LOXAM SAS 6.375% 31-05-29	EUR	3 700 000	3 941 898,29	0,96
REXEL 2.125% 15-12-28	EUR	2 800 000	2 670 460,72	0,65
Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC)			7 804 221,65	1,90
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI 0.75% 22-06-29	EUR	5 500 000	4 982 757,40	1,21
UNIBAIL RODAMCO SE 1.5% 29-05-29	EUR	3 000 000	2 821 464,25	0,69
Textiles, habillement et produits de luxe			1 157 449,94	0,28
TAPESTRY 7.35% 27-11-28	USD	1 200 000	1 157 449,94	0,28
Transport routier et ferroviaire			4 162 573,33	1,01
OI EUROPEAN GROUP BV 5.25% 01-06-29	EUR	4 000 000	4 162 573,33	1,01
TITRES D'OPC			26 454 049,66	6,43
OPCVM			26 454 049,66	6,43
Gestion collective			26 454 049,66	6,43
AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM SRI part E-C	EUR	2 232	23 158 474,24	5,63
CPR CASH P SICAV	EUR	114	2 669 131,02	0,65
OSTRUM SRI CASH Part Z2	EUR	60	626 444,40	0,15
TITRES FINANCIERS DONNÉS EN PENSION			20 872 428,13	5,07
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assim	ilé		20 872 428,13	5,07
Compagnies aériennes			1 140 398,63	0,28
AIR FR KLM 4.625% 23-05-29	EUR	1 100 000	1 140 398,63	0,28
Composants automobiles			2 159 491,78	0,52
VALEO 5.875% 12-04-29 EMTN	EUR	2 000 000	2 159 491,78	0,52
Construction et ingénierie			719 082,08	0,17
HOCHTIEF AG 0.625% 26-04-29	EUR	800 000	719 082,08	0,17
Distribution de produits alimentaires de première nécessité			2 543 320,71	0,62
WORLDLINE 4.125% 12-09-28 EMTN	EUR	2 600 000	2 543 320,71	0,62
Logiciels	2011		11 628 971,24	2,83
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 3.75% 25-03-29	EUR	6 800 000	7 011 298,36	1,71
NEXI 2.125% 30-04-29	EUR	4 900 000	4 617 672,88	1,12
Marches de capitaux	2010	. 555 556	2 681 163,69	0,65
TELENET FINANCE LUX NOTE 3.5% 01-03-28	EUR	2 700 000	2 681 163,69	0,65
DETTES REPRÉSENTATIVES DES TITRES DONNÉS EN PENSION	LOIX	2700000	-22 864 575,00	- 5,56
INDEMNITÉS SUR TITRES DONNÉS EN PENSION			-87 152,58	-0,02
Total			•	
IUIAI			411 622 807,25	100,05

^(*) 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

	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)			
Type d'opération	A - 4.5	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
	Actif		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				
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 - 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.

øInventaire des instruments financiers à terme - de change

Nature d'engagements	Quantité ou	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
3 3	Nominal	Actif	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				
FIX/3.455/FIX/1.875	1 756 831,14	180 962,24	0,00	1 756 831,14
FIX/3.517/FIX/1.875	1 400 870	141 969,28	0,00	1 400 870,00
FIX/3.545/FIX/1.875	1 284 356,26	132 836,03	0,00	1 284 356,26
FIX/3.55/FIX/5.375	1 222 653,93	37 340,39	0,00	1 222 653,93
FIX/3.555/FIX/5.375	1840 603,72	14 806,20	0,00	1840603,72
FIX/3.605/FIX/5.381	1307 922,27	33 960,60	0,00	1 307 922,27
FIX/3.642/FIX/5.25	1 869 508,32	48 289,96	0,00	1 869 508,32
FIX/3.67/FIX/5.381	2 806 000	84 092,22	0,00	2 806 000,00
FIX/3.735/FIX/5.875	1169748,94	0,00	-65 511,00	1169748,94
FIX/3.8/FIX/5.875	1 166 714	0,00	-65 219,15	1166714,00
FIX/3.925/FIX/6.0	1 128 137,63	18 212,29	0,00	1 128 137,63
FIX/3.97/FIX/5.875	1284 469	0,00	-60 230,84	1284 469,00
FIX/4.0/FIX/5.625	1 169 584	0,00	-55 477,32	1169 584,00
FIX/4.03/FIX/5.113	1 410 902	83 620,24	0,00	1 410 902,00
FIX/4.046/FIX/5.113	927 242,95	41 879,05	0,00	927 242,95
FIX/4.096/FIX/5.113	1195 627,24	48 987,80	0,00	1 195 627,24
FIX/4.108/FIX/3.75	1 392 098,68	148 334,47	0,00	1392098,68
FIX/4.13/FIX/5.25	1397830	0,00	-25 012,54	1397 830,00
FIX/4.13/FIX/6.0	1 122 754,49	23 252,02	0,00	1122754,49
FIX/4.14/FIX/6.0	1 221 804,51	31 828,74	0,00	1 221 804,51
FIX/4.15/FIX/5.25	1163 762	0,00	-19 921,37	1163762,00
FIX/4.166/FIX/5.625	1 162 299,03	0,00	-58 575,34	1162 299,03
FIX/4.17/FIX/5.25	1 167 639	0,00	-16 129,17	1 167 639,00
FIX/4.207/FIX/3.75	1 220 198,98	152 472,61	0,00	1 220 198,98
FIX/4.211/FIX/5.113	933 936	56 448,01	0,00	933 936,00
FIX/4.222/FIX/5.113	1 221 460,41	82 179,91	0,00	1 221 460,41
FIX/4.282/FIX/5.113	1 398 452,13	86 673,99	0,00	1 398 452,13
FIX/4.285/FIX/3.75	1 198 005	127 477,12	0,00	1198 005,00
FIX/4.307/FIX/5.625	1 749 271,14	0,00	-67 231,61	1 749 271,14
FIX/4.325/FIX/3.75	1 120 200	140 174,12	0,00	1 120 200,00
FIX/4.3545/FIX/5.25	1169864,3	0,00	-1 021,64	1169864,30
FIX/4.36/FIX/5.25	1 520 529	1 619,38	0,00	1 520 529,00
FIX/4.38/FIX/3.75	1 125 597,98	148 522,23	0,00	1 125 597,98
FIX/4.445/FIX/7.35	1 128 114,11	0,00	-14 698,28	1 128 114,11
FIX/4.46/FIX/5.25	1 404 983	9 235,70	0,00	1 404 983,00
FIX/4.465/FIX/5.25	1 399 979	2 249,67	0,00	1399979,00
FIX/4.535/FIX/6.5	1 637 762	0,00	-67 561,05	1 637 762,00
FIX/4.539/FIX/6.5	1167 682	0,00	-50 297,87	1167 682,00
FIX/4.561/FIX/6.5	1397 443,38	0,00	-63 223,66	1397 443,38
FIX/4.61/FIX/6.5	1162844,78	0,00	-52 129,66	1 162 844,78

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	+/-
FIX/4.691/FIX/7.5	2 780 352,17	0,00	-61 347,15	2 780 352,17
FIX/4.7/FIX/6.5	1 519 151	0,00	-53 668,39	1 519 151,00
FIX/4.807/FIX/6.5	1 282 499,71	0,00	-42 828,31	1 282 499,71
FIX/4.895/FIX/7.5	922 509,23	0,00	-17 151,98	922 509,23
Sous-total 3.		1 877 424,27	-857 236,33	60 030 194,43
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		1877 424,27	-857 236,33	60 030 194,43

^(*) 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 présentée au bilan		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	Valeur actuelle présentée au bilan		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 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)	411 622 807,25
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	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	0,00
Total instruments financiers à terme - change	1 020 187,94
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 (+)	69 204,65
Autres passifs (-)	-1 301 767,40
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	411 410 432,44

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part LBPAM ISR OBLI JUIN 2029 PART RC	EUR	3 991 431,45861	102,98
Part LBPAM ISR OBLI JUIN 2029 PART RD	EUR	3 513,47711	102,98