

Rapport semestriel

au 30 septembre 2024

LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES

Part I, Part L, Part X, Part GP, Part J

FORME JURIDIQUE DE L'OPC

FCP de droit français

CLASSIFICATION

N/A

AFFECTATION DES RÉSULTATS

Le FCP est un OPCVM de capitalisation et/ou de distribution et/ou de report pour les parts I,J, L, X et GP. Il pourra procéder à la distribution d'acomptes.

Le directoire de 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	2 075 898,53 euros soit 1,01 % 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 (42,80 %), CREDIT AGR CIB (34,3 %), JEFFERIES GMBH (22,9 %)
Données sur la concentration (opérations de prise en pensior	n)
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 (42,80 %), France (34,3 %), MISSING COUNTRY CODE (22,9 %)
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	2 042,20
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 : 8 996 euros (67 % des revenus) Gestionnaire de l'OPC : 4 431 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	198 868 698,07
b) Avoirs bancaires	304 074,37
c) Autres actifs détenus par l'OPC	10 552 090,42
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	209 724 862,86
e) Passif	-3 831 012,17
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	205 893 850,69

^(*) 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 CONVERTIBLES OPPORTUNITES I en EUR	D	45 449 597,30	3 701,62602	12 278,27
LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES J en EUR	D	29 493 204,51	2 928,00000	10 072,81
LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES L en EUR	D	72 630 245,22	62 718,28155	1 158,03
LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES X en EUR	D	58 320 803,66	4 679,99980	12 461,71

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.	80,21	78,74
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.	16,38	16,08
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.	3,80	3,73

^(*) 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	177 081 431,13	86,01	84,44
Dollar Us	USD	19 552 905,51	9,50	9,32
Franc Suisse	CHF	1 465 879,97	0,71	0,70
Livre Sterling	GBP	768 481,46	0,37	0,37
TOTAL		198 868 698,07	96,59	94,82

^(*) 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	27,23	26,74
ALLEMAGNE	14,84	14,57
PAYS-BAS	10,98	10,78
ITALIE	10,80	10,61
ESPAGNE	10,50	10,31
ETATS-UNIS	8,28	8,13
SUISSE	6,51	6,40
BELGIQUE	3,01	2,95
LUXEMBOURG	2,78	2,73
ROYAUME-UNI	1,09	1,07
MEXIQUE	0,49	0,48
AUTRICHE	0,07	0,06
TOTAL	96,59	94,82

^(*) 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	3,80	3,73
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	3,80	3,73

^(*) 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 montefacillo 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. 	61 554 902,38	55 037 659,72
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.	13 614 339,19	8 628 091,53
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.	39 966 203,86	53 019 085,32

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 CONVERTIBLES OPPORTUNITES I				
	LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES J				
	LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES L				
	LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES X				
Dividendes à v	verser				
	LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES I				
	LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES J				
	LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES L				
	LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES X				

INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES

	30/09/2024
PART LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES I	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
PART LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES J	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
PART LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES L	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
PART LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES X	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00

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			8 318 223,51	4,04
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			8 318 223,51	4,04
Boissons			10 966,45	0,01
REMY COINTREAU	EUR	157	10 966,45	0,01
Conglomérats industriels			829 993,18	0,40
SIEMENS AG-REG	EUR	4 577	829 993,18	0,40
Equipements électriques			1 702 698,00	0,82
PRYSMIAN SPA	EUR	26 115	1 702 698,00	0,82
Industrie aérospatiale et défense			223 977,10	0,11
SAFRAN SA	EUR	1 061	223 977,10	0,11
Pétrole et gaz			768 481,46	0,37
BP PLC	GBP	163 241	768 481,46	0,37
Produits chimiques			1 465 879,97	0,71
SIKA AG-REG	CHF	4 927	1 465 879,97	0,71
Services de télécommunication diversifiés			1 581 785,98	0,77
CELLNEX TELECOM SA	EUR	28 409	1 034 939,87	0,50
KONINKLIJKE KPN NV	EUR	149 045	546 846,11	0,27
Services de télécommunication mobile			135 675,52	0,07
EUROTELESITES AG	EUR	28 384	135 675,52	0,07
Services liés aux technologies de l'information			919 904,85	0,45
CAPGEMINI SE	EUR	4 743	919 904,85	0,45
Textiles, habillement et produits de luxe			678 861,00	0,33
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	EUR	986	678 861,00	0,33
Actions et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé ou assi	milé		0,00	0,00
Boissons			0,00	0,00
REMY COINTREAU RTS 16-09-24	EUR	157	0,00	0,00
OBLIGATIONS CONVERTIBLES EN ACTIONS			188 596 311,28	91,60
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé			188 596 311,28	91,60
Banques commerciales			6 309 100,50	3,06
BARCLAYS BK ZCP 24-01-25 CV	EUR	1 500 000	1 482 382,50	0,72
BNP PAR ZCP 13-05-25 CV	EUR	3 900 000	4 826 718,00	2,34
Boissons			2 981 924,27	1,45
DAVIDE CAMPARI MILANO 2.375% 17-01-29	EUR	2 000 000	1 972 808,86	0,96
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE 2.625% 24-02-26	EUR	1 000 000	1 009 115,41	0,49
Composants automobiles			2 071 920,00	1,01
PIRELLI C ZCP 22-12-25 CV	EUR	2 000 000	2 071 920,00	1,01
Conglomérats industriels			6 182 783,39	3,00
RHEINMETALL AG 1.875% 07-02-28	EUR	3 800 000	6 182 783,39	3,00
Courrier, fret aérien et logistique			1 465 622,46	0,71
DEUTSCHE POST AG 0.05% 30-06-25	EUR	1 500 000	1 465 622,46	0,71
Distribution de produits alimentaires de première nécessité			2 013 588,00	0,98
WORLDLINE ZCP 30-07-25 CV	EUR	18 000	2 013 588,00	0,98
Divertissement			2 732 534,43	1,33
Divertissement			2 732 534,43	1,33
UBISOFT ENTERTAINMENT 2.375% 15-11-28	EUR	3 000 000	2 7 3 2 3 3 4 , 4 3	.,
	EUR	3 000 000	3 765 349,12	1,83
UBISOFT ENTERTAINMENT 2.375% 15-11-28	EUR	3 000 000		
UBISOFT ENTERTAINMENT 2.375% 15-11-28 Electricité			3 765 349,12	1,83

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif
SAIPEM 2.875% 11-09-29 CV	EUR	3 000 000	3 756 983,45	1,82
Equipements électriques			11 163 073,20	5,42
NORDEX AG 4.25% 14-04-30 CV	EUR	1 000 000	1 228 406,56	0,60
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.625% 28-06-31 CV	EUR	3 200 000	3 352 391,34	1,63
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.97% 27-11-30 CV	EUR	5 200 000	6 582 275,30	3,19
Equipements et fournitures médicaux			856 166,34	0,42
DEXCOM 0.25% 15-11-25 CV	USD	1 000 000	856 166,34	0,42
Gaz			2 093 118,67	1,02
SNAM 3.25% 29-09-28 CV EMTN	EUR	2 000 000	2 093 118,67	1,02
Gestion et promotion immobilière			3 842 904,53	1,87
LEG PROPERTIES BV 1.0% 04-09-30	EUR	3 600 000	3 842 904,53	1,87
Gestion immobilière et développement			9 513 768,68	4,62
LEG IMMOBILIEN AG 0.4% 30-06-28	EUR	2 800 000	2 560 526,35	1,24
SIMON GLOBAL DEVELOPMENT BV 3.5% 14-11-26	EUR	4 000 000	4 601 701,30	2,24
TAG IMMOBILIEN AG 0.625% 27-08-26	EUR	2 500 000	2 351 541,03	1,14
Hôtels, restaurants et loisirs			11 294 571,31	5,49
ACCOR 0.7% 07-12-27 CV	EUR	73 000	3 754 244,00	1,82
AMADEUS CM 1.5% 09-04-25 CV	EUR	3 500 000	4 350 790,90	2,12
SPIE 2.0% 17-01-28 DD	EUR	2 700 000	3 189 536,41	1,55
Industrie aérospatiale et défense			8 661 449,08	4,21
MTU AERO ENGINES 0.05% 18-03-27	EUR	2 500 000	2 454 003,08	1,19
SAFRAN ZCP 01-04-28 CV	EUR	28 000	6 207 446,00	3,02
Logiciels			15 180 780,68	7,37
FNAC DARTY 0.25% 23-03-27 CV	EUR	22 800	1 661 014,20	0,81
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 1.125% 18-05-28	EUR	3 500 000	3 546 718,63	1,72
NEXI 1.75% 24-04-27 CV	EUR	7 000 000	6 642 181,61	3,22
ZALANDO SE 0.05% 06-08-25 CV	EUR	2 500 000	2 420 645,21	1,18
ZALANDO SE 0.625% 06-08-27 CV	EUR	1 000 000	910 221,03	0,44
Marches de capitaux			8 602 470,78	4,18
CITIGROUP GLOBAL MKTS FUNDING ZCP 15-03-28 CV	EUR	2 000 000	2 159 250,00	1,05
ENCAVIS FINANCE BV 1.875% PERP	EUR	400 000	388 107,78	0,19
JP MORGAN CHASE FINANCIAL COMPANY LLC ZCP 14-01-25	EUR	3 000 000	3 199 050,00	1,55
JP MORGAN CHASE FINANCIAL COMPANY LLC ZCP 29-04-25	EUR	2 100 000	2 856 063,00	1,39
Métaux et minerais			8 191 477,75	3,98
RAG STIFTUNG 1.875% 16-11-29	EUR	2 200 000	2 601 658,84	1,26
RAG STIFTUNG 2.25% 28-11-30 CV	EUR	1 700 000	2 022 268,91	0,98
RAG STIFTUNG ZCP 17-06-26 CV	EUR	3 500 000	3 567 550,00	1,74
Outils et services appliqués aux sciences biologiques			6 750 057,56	3,28
QIAGEN NV 1.0% 13-11-24 CV	USD	4 200 000	3 769 034,25	1,83
QIAGEN NV 2.5% 10-09-31 CV	USD	1 400 000	1 291 905,44	0,63
QIAGEN NV ZCP 17-12-27 CV	USD	2 000 000	1 689 117,87	0,82
Pétrole et gaz			4 005 981,70	1,95
ENI 2.95% 14-09-30 CV EMTN	EUR	3 900 000	4 005 981,70	1,95
Semi-conducteurs et équipements pour fabrication			14 572 371,77	7,08
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV 1.875% 06-04-29	EUR	2 000 000	2 625 690,16	1,28
STMICROELECTRONICS NV ZCP 04-08-25	USD	9 800 000	8 533 389,19	4,14
STMICROELECTRONICS NV ZCP 04-08-27	USD	3 800 000	3 413 292,42	1,66
Services aux collectivités			9 988 032,93	4,85
IBERDROLA FINANZAS SAU 0.8% 07-12-27 CV	EUR	6 100 000	6 808 133,00	3,31
VEOLIA ENVIRONNEMENT ZCP 01-01-25	EUR	100 582	3 179 899,93	1,54
Services aux entreprises			10 207 712,17	4,96
ELIS EX HOLDELIS 2.25% 22-09-29	EUR	2 200 000	2 848 431,16	1,38
LAGFIN SCA 3.5% 08-06-28 CV	EUR	3 800 000	3 566 881,01	1,73
SAGERPAR ZCP 01-04-26 CV	EUR	4 000 000	3 792 400,00	1,85

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Services clientèle divers			4 099 935,00	1,99
EDENRED ZCP 14-06-28 CV	EUR	70 000	4 099 935,00	1,99
Services de télécommunication diversifiés			5 878 177,81	2,85
CELLNEX TELECOM 0.5% 05-07-28 CV	EUR	4 000 000	4 280 156,71	2,07
CELLNEX TELECOM 2.125% 11-08-30 CV	EUR	1 500 000	1 598 021,10	0,78
Services financiers diversifiés			22 414 455,70	10,87
CITIGROUP GLOBAL MKTS 1.0% 09-04-29 CV	EUR	10 200 000	10 142 793,37	4,90
GROUPE BRUXELLES LAMBERT 2.125% 29-11-25	EUR	2 400 000	2 401 782,03	1,17
MERRILL LYNCH BV ZCP 30-01-26	EUR	3 800 000	3 845 239,00	1,87
ORPAR 2.0% 07-02-31 CV	EUR	1 000 000	947 525,46	0,46
WENDEL 2.625% 27-03-26 CV	EUR	4 800 000	5 077 115,84	2,47
TITRES D'OPC			7 826 453,12	3,80
OPCVM			7 826 453,12	3,80
Gestion collective			7 826 453,12	3,80
OSTRUM SRI CASH Part M	EUR	434	4 539 219,02	2,20
OSTRUM SRI CASH Part Z2	EUR	15	156 611,10	0,08
OSTRUM SRI CASH Z	EUR	300	3 130 623,00	1,52
TITRES FINANCIERS MIS EN DÉPOSIT			1 954 163,28	0,95
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé			1 954 163,28	0,95
Courrier, fret aérien et logistique			1 954 163,28	0,95
DEUTSCHE POST AG 0.05% 30-06-25	EUR	2 000 000	1 954 163,28	0,95
TITRES FINANCIERS DONNÉS EN PENSION			2 109 237,24	1,02
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé			2 109 237,24	1,02
Distribution de produits alimentaires de première nécessité			492 414,51	0,24
HELLOFRESH SE 0.75% 13-05-25	EUR	500 000	492 414,51	0,24
Semi-conducteurs et équipements pour fabrication			1 616 822,73	0,78
STMICROELECTRONICS NV ZCP 04-08-27	USD	1 800 000	1 616 822,73	0,78
DETTES REPRÉSENTATIVES DES TITRES DONNÉS EN PENSION			-2 075 898,53	-1,01
INDEMNITÉS SUR TITRES DONNÉS EN PENSION			-4 582,68	0,00
Total			206 723 907,22	100,40

^(*) 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	'expositi	on (*)
Type d'opération	A -+:6	Dece:f	Devi	ses à recevoir (+)	De	vises à livrer (-)
	Actif	Passif	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	Nature d'engagements Quantité ou Nominal		Valeur actuelle présentée au bilan		
	Nominal	Actif	Passif	+/-	
1. Futures					
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00	
2. Options					
EURO STOXX 50 12/2024 PUT 4900	200	196 800,00	0,00	-3 560 320,40	
LVMH MOET HENNE 12/2024 CALL 680	22	87 516,00	0,00	875 496,60	
STMICROELECTRONI 03/2025 CALL 29	400	74 400,00	0,00	464 776,00	
Sous-total 2.		358 716,00	0,00	-2 220 047,80	
3. Swaps					
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00	
4. Autres instruments					
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00	
Total		358 716,00	0,00	-2 220 047,80	

^(*) 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 bil	Montant de l'exposition (*)	
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
EURO BOBL 1224	27	37 530,00	0,00	3 241 350,00
Sous-total 1.		37 530,00	0,00	3 241 350,00
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		37 530,00	0,00	3 241 350,00

^(*) 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 bil	Montant de l'exposition (*)	
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
EC EURUSD 1224	62	15 809,10	0,00	7 754 166,48
RP EURGBP 1224	-9	16 495,40	0,00	-1 128 921,04
Sous-total 1.		32 304,50	0,00	6 625 245,44
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		32 304,50	0,00	6 625 245,44

^(*) 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 bil	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				
ITRAXX EUR XOVER S41	2 000 000	187 535,56	0,00	2 000 000,00
Sous-total 4.		187 535,56	0,00	2 000 000,00
Total		187 535,56	0,00	2 000 000,00

^(*) 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 actuell bil	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)	206 723 907,22
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	358 716,00
Total instruments financiers à terme - taux	37 530,00
Total instruments financiers à terme - change	32 304,50
Total instruments financiers à terme - crédit	187 535,56
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 (+)	304 388,37
Autres passifs (-)	-1 750 530,96
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	205 893 850,69

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES I	EUR	3 701,62602	12 278,27
Part LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES J	EUR	2 928,00000	10 072,81
Part LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES L	EUR	62 718,28155	1158,03
Part LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES X	EUR	4 679,99980	12 461,71