



Rapport semestriel

au 30 septembre 2025

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

lbpam.com

INFORMATIONS RÉGLEMENTAIRES CONCERNANT L'OPC

Néant

INFORMATIONS RELATIVES AUX CESSIIONS 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	6 222 038 euros soit 2,88 % de l'actif net
Données sur la concentration (opérations de mise en pension)	
Les 10 plus gros émetteurs de garantie	—
Les 10 principales contreparties pour les opérations de mise en pension	BNPP FRANCE (84 %), JEFFERIES GMBH (16,0 %)
Données sur la concentration (opérations de prise en pension)	
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)	
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 (84 %), Allemagne (16,0 %)
Règlement et compensation	Bilatéral
Données d'opération agrégées (opérations de prise en pension)	
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	26 697,62
Conservation des garanties reçues par l'OPC dans le cadre des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global	
Nombre de dépositaires	1
Noms des dépositaires	0
Conservation des garanties fournies par l'OPC dans le cadre des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global	
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 : 53 775 euros (67 % des revenus) Gestionnaire de l'OPC : 26 486 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	203 362 900,74
b) Avoirs bancaires	108 517,27
c) Autres actifs détenus par l'OPC	26 005 961,86
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	229 477 379,87
e) Passif	-13 380 038,02
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	216 097 341,85

(*) 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	C/D/R	34 689 923,26	2 481,76065	13 977,94
LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES J en EUR	C/D/R	36 639 881,00	3 192,00000	11 478,65
LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES L en EUR	C/D/R	73 154 681,04	55 823,90188	1 310,45
LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES X en EUR	C/D/R	71 612 856,55	5 035,25649	14 222,28

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.	76,55	72,09
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.		
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.	17,55	16,53
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.	6,49	6,11

(*) 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	179 720 648,95	83,17	78,32
Dollar Us	USD	22 708 870,28	10,51	9,90
Franc Suisse	CHF	933 381,51	0,43	0,41
TOTAL		203 362 900,74	94,11	88,62

(*) 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	22,76	21,43
ALLEMAGNE	21,31	20,06
PAYS-BAS	11,11	10,46
ETATS-UNIS	10,37	9,77
ESPAGNE	8,75	8,24
SUISSE	7,18	6,76
ITALIE	7,13	6,72
LUXEMBOURG	3,68	3,46
BELGIQUE	1,83	1,72
TOTAL	94,11	88,62

(*) 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	6,49	6,11
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	6,49	6,11

(*) 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

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	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.	93 343 849,03	83 618 790,76
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.	9 962 342,58	1 400 759,49
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.	71 148 672,23	76 528 333,26

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR	Montant éligible à réfaction EUR
Dividendes versés					
	LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES I				
	LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES J				
	LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES L				
	LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES X				
Dividendes à 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

	30/09/2025
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			3 857 825,10	1,79
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			3 857 825,10	1,79
Banques commerciales			782 734,26	0,36
BNP PARIBAS	EUR	10 122	782 734,26	0,36
Boissons			7 218,86	0,00
REMY COINTREAU	EUR	157	7 218,86	0,00
Produits chimiques			933 381,51	0,43
SIKA AG-REG	CHF	4 927	933 381,51	0,43
Services de télécommunication diversifiés			1 548 492,82	0,73
CELLNEX TELECOM SA	EUR	28 409	837 781,41	0,40
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	EUR	14 000	406 140,00	0,19
KONINKLIJKE KPN NV	EUR	74 522	304 571,41	0,14
Services liés aux technologies de l'information			585 997,65	0,27
CAPGEMINI SE	EUR	4 743	585 997,65	0,27
OBLIGATIONS CONVERTIBLES EN ACTIONS			195 383 490,31	90,42
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé			195 383 490,31	90,42
Boissons			1 941 098,86	0,90
DAVIDE CAMPARI MILANO 2.375% 17-01-29	EUR	2 000 000	1 941 098,86	0,90
Composants automobiles			2 060 810,00	0,95
PIRELLI C ZCP 22-12-25 CV	EUR	2 000 000	2 060 810,00	0,95
Conglomérats industriels			8 328 260,09	3,85
RHEINMETALL AG 2.25% 07-02-30	EUR	1 300 000	8 328 260,09	3,85
Electricité			6 658 207,00	3,08
LEGRAND 1.5% 23-06-33 CV	EUR	6 100 000	6 658 207,00	3,08
Equipement et services pour l'énergie			4 547 153,45	2,10
SAIPEM 2.875% 11-09-29 CV	EUR	3 000 000	4 547 153,45	2,10
Equipements électriques			15 437 689,08	7,14
NORDEX AG 4.25% 14-04-30 CV	EUR	2 400 000	3 885 411,74	1,80
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.25% 23-09-33 CV	EUR	3 000 000	3 033 995,14	1,40
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.625% 28-06-31 CV	EUR	1 700 000	1 816 198,90	0,84
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.97% 27-11-30 CV	EUR	5 200 000	6 702 083,30	3,10
Gestion et promotion immobilière			4 017 932,27	1,86
LEG PROPERTIES BV 1.0% 04-09-30	EUR	4 100 000	4 017 932,27	1,86
Gestion immobilière et développement			17 969 294,58	8,32
SIMON GLOBAL DEVELOPMENT BV 3.5% 14-11-26	EUR	4 000 000	4 981 981,30	2,31
TAG IMMOBILIEN AG 0.625% 11-03-31	EUR	4 000 000	4 189 930,28	1,94
VONOVIA SE ZCP 20-05-30 CV	EUR	8 900 000	8 797 383,00	4,07
Hôtels, restaurants et loisirs			12 426 237,87	5,75
ACCOR 0.7% 07-12-27 CV	EUR	88 000	4 728 812,00	2,19
SPIE 2.0% 17-01-28 DD	EUR	2 500 000	3 637 799,46	1,68
TUI AG 1.95% 26-07-31 CV	EUR	3 500 000	4 059 626,41	1,88
Industrie aérospatiale et défense			1 939 234,60	0,90
MTU AERO ENGINES 0.05% 18-03-27	EUR	1 700 000	1 939 234,60	0,90

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Logiciels			17 934 881,50	8,30
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 1.125% 18-05-28	EUR	3 700 000	5 220 952,26	2,42
NEXI 1.75% 24-04-27 CV	EUR	7 000 000	6 863 626,61	3,17
VINCI 0.7% 18-02-30 CV	EUR	4 700 000	4 886 876,60	2,26
ZALANDO SE 0.625% 06-08-27 CV	EUR	1 000 000	963 426,03	0,45
Marchés de capitaux			15 602 943,45	7,22
CARA OBLIGATIONS SAS 1.5% 01-12-30	EUR	3 000 000	3 654 556,23	1,69
CITIGROUP GLOBAL MKTS FUNDING ZCP 15-03-28 CV	EUR	4 000 000	4 181 380,00	1,93
GOLD SACH GR ZCP 07-05-30 CV	EUR	3 800 000	4 229 799,00	1,96
JP MORGAN CHASE FINANCIAL COMPANY LLC 0.1% 20-05-30	EUR	1 600 000	1 567 647,11	0,73
JP MORGAN CHASE FINANCIAL COMPANY LLC 0.5% 27-03-30	EUR	2 000 000	1 969 561,11	0,91
Métaux et minerais			7 707 648,64	3,57
RAG STIFTUNG 1.875% 16-11-29	EUR	2 200 000	2 306 616,84	1,07
RAG STIFTUNG 2.25% 28-11-30 CV	EUR	3 700 000	3 923 516,80	1,82
RAG STIFTUNG ZCP 17-06-26 CV	EUR	1 500 000	1 477 515,00	0,68
Outils et services appliqués aux sciences biologiques			8 122 709,43	3,76
QIAGEN NV 2.0% 04-09-32 CV	USD	2 000 000	1 690 381,69	0,78
QIAGEN NV 2.5% 10-09-31 CV	USD	7 400 000	6 432 327,74	2,98
Semi-conducteurs et équipements pour fabrication			17 232 601,01	7,97
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV 1.875% 06-04-29	EUR	2 000 000	2 646 440,16	1,22
STMICROELECTRONICS NV ZCP 04-08-27	USD	17 400 000	14 586 160,85	6,75
Services aux collectivités			7 851 902,96	3,63
IBERDROLA FINANZAS SAU 0.8% 07-12-27 CV	EUR	4 300 000	5 379 417,72	2,49
IBERDROLA FINANZAS SAU 1.5% 27-03-30 CV	EUR	2 400 000	2 472 485,24	1,14
Services aux entreprises			11 951 481,89	5,53
ELIS EX HOLDELIS 2.25% 22-09-29	EUR	2 700 000	4 244 052,88	1,96
LAGFIN SCA 3.5% 08-06-28 CV	EUR	3 800 000	3 762 429,01	1,74
SAGERPAR ZCP 01-04-26 CV	EUR	4 000 000	3 945 000,00	1,83
Services clientèle divers			2 374 880,00	1,10
EDENRED ZCP 14-06-28 CV	EUR	40 000	2 374 880,00	1,10
Services de télécommunication diversifiés			4 998 307,33	2,31
CELLNEX TELECOM 0.75% 20-11-31 CV	EUR	5 500 000	4 998 307,33	2,31
Services financiers diversifiés			20 515 578,30	9,51
CITIGROUP GLOBAL MKTS 0.8% 05-02-30 CV	EUR	4 300 000	4 639 628,43	2,15
CITIGROUP GLOBAL MKTS 1.0% 09-04-29 CV	EUR	10 200 000	10 003 869,37	4,64
EURONEXT NV 1.5% 30-05-32 CV	EUR	100 000	99 569,01	0,05
MERRILL LYNCH BV 0.1% 28-04-30 CV	EUR	4 000 000	3 831 648,89	1,77
ORPAR 2.0% 07-02-31 CV	EUR	2 000 000	1 940 862,60	0,90
Soins et autres services médicaux			5 764 638,00	2,67
FRESENIUS SE 0.0% 11-03-28 CV	EUR	5 700 000	5 764 638,00	2,67
OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			4 121 585,33	1,91
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			4 121 585,33	1,91
Machines			4 121 585,33	1,91
EXAIL TECHNOLOGIES 4.0% PERP	EUR	3 500 000	4 121 585,33	1,91
TITRES D'OPC			14 029 143,62	6,49
OPCVM			14 029 143,62	6,49
Gestion collective			14 029 143,62	6,49

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OSTRUM ISR CASH EONIA Part Z2	EUR	20	214 275,00	0,10
OSTRUM SRI CASH Part M	EUR	470	5 044 787,30	2,33
OSTRUM SRI CASH Z	EUR	819	8 770 081,32	4,06
CRÉANCES REPRÉSENTATIVES DE TITRES PRÊTÉS			2 263 180,43	1,05
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé			2 263 180,43	1,05
Equipements électriques			1 068 352,30	0,49
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.625% 28-06-31 CV	EUR	1 000 000	1 068 352,30	0,49
Services financiers diversifiés			1 194 828,13	0,56
EURONEXT NV 1.5% 30-05-32 CV	EUR	1 200 000	1 194 828,13	0,56
INDEMNITÉS SUR TITRES PRÊTÉS			2 509,14	0,00
TITRES FINANCIERS DONNÉS EN PENSION			6 298 977,90	2,91
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé			6 298 977,90	2,91
Equipements électriques			534 176,15	0,25
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.625% 28-06-31 CV	EUR	500 000	534 176,15	0,25
Industrie aéronautique et défense			2 851 815,58	1,31
MTU AERO ENGINES 0.05% 18-03-27	EUR	2 500 000	2 851 815,58	1,31
Marchés de capitaux			365 455,62	0,17
CARA OBLIGATIONS SAS 1.5% 01-12-30	EUR	300 000	365 455,62	0,17
Services financiers diversifiés			2 547 530,55	1,18
CITIGROUP GLOBAL MKTS 0.8% 05-02-30 CV	EUR	700 000	755 288,35	0,35
EURONEXT NV 1.5% 30-05-32 CV	EUR	1 800 000	1 792 242,20	0,83
DETTES REPRÉSENTATIVES DES TITRES DONNÉS EN PENSION			-6 222 038,00	-2,88
INDEMNITÉS SUR TITRES DONNÉS EN PENSION			9 364,45	0,00
Total			219 744 038,28	101,69

(*) 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				
EURO STOXX 50 1225	-40	0,00	-8 230,00	-2 216 400,00
Sous-total 1.		0,00	-8 230,00	-2 216 400,00
2. Options				
EURO STOXX 50 12/2025 CALL 5450	210	433 650,00	0,00	7 037 427,10
EURO STOXX 50 12/2025 PUT 5100	130	61 100,00	0,00	-1 207 743,26
EURO STOXX 50 12/2025 PUT 5450	210	243 390,00	0,00	-4 563 875,99
EVONIK INDUSTRIE 12/2025 CALL 17	500	5 000,00	0,00	94 848,00
LVMH MOET HENNE 06/2026 CALL 560	25	87 275,00	0,00	560 838,75
STMICROELECTRONI 06/2026 CALL 28	200	35 200,00	0,00	183 645,00
Sous-total 2.		865 615,00	0,00	2 105 139,60
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		865 615,00	-8 230,00	-111 260,40

(*) 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				
EURO BOBL 1225	51	510,00	0,00	6 008 310,00
EURO BUND 1225	29	19 720,00	0,00	3 728 530,00
Sous-total 1.		20 230,00	0,00	9 736 840,00
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		20 230,00	0,00	9 736 840,00

(*) 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				
EC EURUSD 1225	78	4 978,72	0,00	9 784 851,06
RP EURGBP 1225	-9	0,00	-9 602,72	-1 129 962,48
Sous-total 1.		4 978,72	-9 602,72	8 654 888,58
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		4 978,72	-9 602,72	8 654 888,58

(*) 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				
ITRAXX EUROPE 5Y S43	986 660	107 614,95	0,00	986 660,00
ITRAXX EUROPE 5Y S43	1 973 320	215 229,89	0,00	1 973 320,00
Sous-total 4.		322 844,84	0,00	2 959 980,00
Total		322 844,84	0,00	2 959 980,00

(*) 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)	219 744 038,28
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	857 385,00
Total instruments financiers à terme - taux	20 230,00
Total instruments financiers à terme - change	-4 624,00
Total instruments financiers à terme - crédit	322 844,84
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 (+)	2 306 999,48
Autres passifs (-)	-7 149 531,75
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	216 097 341,85

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES I	EUR	2 481,76065	13 977,94
Part LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES J	EUR	3 192,00000	11 478,65
Part LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES L	EUR	55 823,90188	1 310,45
Part LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES X	EUR	5 035,25649	14 222,28

Stock : Stock adm. p.ri. nci. pal. au 30/09/25
PORTFOLIO : 000500 LBPAMI SR CONVERTIBLES OPPORTUNITES

VA. VAL. DEE

Devise de fixation : FRF
Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifié, trame : FC23 TR AM/TYRE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE, Tris : B/L04)

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

V A L E U R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE	DEV	P R U EN DEV	SE	DATE	COURS	VAL. EUR	I	FR X REA	BN	TOTA	VAL. EUR	BORSES	COURON	COURS	TOTA	PLUS	OU MOINS	VAL	ACT	NET
-------------	---------	---------	----------	-----	--------------	----	------	-------	----------	---	----------	----	------	----------	--------	--------	-------	------	------	----------	-----	-----	-----

0-ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES

ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE OU ASSIMILE

DEVISE VALEUR : CHF FRANCO SUISSE														
Q0418792922	SI KA AG REG		4, 927.	P	CHF	246. 2	M 30/ 09/ 25	177. 1	T	1, 268, 591, 71	933, 381, 51	0, 00	- 335, 210, 20	0, 43
DEVISE VALEUR : EUR EURO														
FR0000131104	BNP PAR BAS		10, 122.	P	EUR	77.	M 30/ 09/ 25	77, 33	T	779, 394, 00	782, 734, 26	0, 00	3, 340, 26	0, 36
FR0000125338	CAREM N. SE		4, 743.	P	EUR	108, 7281	M 30/ 09/ 25	123, 55	T	515, 697, 38	585, 997, 65	0, 00	70, 300, 27	0, 27
ES010506007	CELINEX TELECOM		28, 409.	P	EUR	38, 4	M 30/ 09/ 25	29, 49	T	1, 090, 905, 60	837, 781, 41	0, 00	- 253, 124, 19	0, 39
DE000557508	DEUTSCHE TELEKOM		14, 000.	P	EUR	33, 81	M 30/ 09/ 25	29, 01	T	473, 340, 00	406, 140, 00	0, 00	- 67, 200, 00	0, 19
NL000009082	KPN (KONIN NV)		74, 822.	P	EUR	3, 25	M 30/ 09/ 25	4, 087	T	242, 196, 50	304, 571, 41	0, 00	62, 374, 91	0, 14
FR0000130395	REMY COINTEAU		157.	P	EUR	146, 25	M 30/ 09/ 25	45, 98	T	22, 961, 25	7, 218, 86	0, 00	- 15, 742, 39	0, 00
Sous TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO														

1-OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES

OBLIGATIONS CONVERTIBLES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE

DEVISE VALEUR : EUR EURO																						
FR0013521085	ACCOR	0,7	12,27	(US)	071227	88,000	P	EUR	53,7516	M30/09/25	53,7365	4	4,730,137,72	4,728,812,00	24,119,59	-1,325,72	2,19					
XS2465773070	EE	SEM	1,875	04-29	(US)	060429	2,000,000	M	EUR	100,7823	131,405	4	2,015,645,84	2,646,440,16	18,340,16	630,794,32	1,22					
FR0014010153	CAR	CB	1,5	12-30	PLU V	1318754928	300,000	M	EUR	99,9645	121,421	4	289,863,64	365,455,62	1,192,62	65,591,98	0,17					
XS257580857	CEL	TE	0,75	11-31	(US)	011230	3,000,000	M	EUR	100,1157	121,421	4	3,003,471,12	3,654,556,23	11,926,23	651,085,11	1,69					
XS2982266343	CIT	Q	0,8	02-30	(366)	201131	5,500,000	M	EUR	90,4812	90,229	4	4,976,466,09	4,998,307,33	35,712,33	21,841,24	2,31					
PLU V										131768052		700,000	M	EUR	107,3745	700,000,00	4,539,628,43	22,524,93	50,301,37	-303,530,62	4,63	
XS2782912518	CIT	Q	1,0	04-29	(366)	050230	4,300,000	M	EUR	102,759	107,3745	4	4,418,636,99	4,181,380,00	9,938,86	45,480,00	1,93					
XS2566032095	CIT	Q	0,3	03-28	(366)	090429	10,200,000	M	EUR	101,0529	97,584	4	10,307,399,99	10,003,869,37	50,301,37	-303,530,62	4,63					
XS2740429589	DAM	CA	2,375	01-29	(999)	150328	4,000,000	M	EUR	103,3975	104,5345	4	4,135,900,00	4,181,380,00	0,00	-45,480,00	1,93					
FR0014003796	EDHEF	ZCP	06-28	(US)	170129	140628	2,000,000	P	EUR	99,9987	96,558	4	1,999,973,94	1,941,098,86	9,938,86	-58,875,08	0,90					
FR0014004519	ELIS	EX	2,25	09-29	(999)	220929	2,700,000	M	EUR	61,25	157,1255	4	3,457,192,33	4,244,052,88	1,664,38	766,860,55	1,96					
PLU V										1320937499		1,800,000	M	EUR	102,5742	1,792,242,20	9,171,20	-54,092,87	0,83			
PRETERM										172214112		1,200,000	M	EUR	99,0595	1,194,828,13	6,114,13	-36,061,91	0,55			
DE000407599	FRES	SE	0,0	03-28	(US)	300532	100,000	M	EUR	102,5742	99,0595	4	102,574,17	99,569,01	509,51	-3,005,16	0,05					
XS2565341708	GOLD	SACH	ZCP	05-30	(366)	110328	5,700,000	M	EUR	102,4286	101,134	4	5,838,430,00	5,764,638,00	0,00	-73,792,00	2,67					
XS2557565830	IBER	FI	0,8	12-27	(999)	070530	3,800,000	M	EUR	101,15	111,3105	4	3,843,700,03	4,229,799,00	0,00	386,088,97	1,96					
XS3043368806	IBER	FI	1,5	03-30	(US)	071227	4,300,000	M	EUR	100,5407	124,847	4	4,323,248,51	5,379,417,72	10,996,72	1,056,169,21	2,49					
XS243113101	INTL	CO	1,125	05-28	(US)	270330	2,400,000	M	EUR	100	102,9995	4	2,400,000,00	2,472,485,24	497,24	72,485,24	2,42					
XS3076174393	JP	MORG	0,1	05-30	(US)	180528	3,700,000	M	EUR	133,4676	140,688	4	4,938,302,86	5,220,952,26	15,496,26	282,649,40	2,42					
XS3076174393	JP	MORG	0,5	03-30	(EUR)	200530	1,600,000	M	EUR	100,0003	97,9435	4	1,600,004,45	1,567,647,11	551,11	-32,357,34	0,73					
XS2630755404	LAF	SC	3,5	06-28	(EUR)	270330	2,000,000	M	EUR	100	98,5552	4	2,000,000,00	1,969,561,11	5,111,11	-30,438,89	0,91					
DE0004312101	LEG	ROF	1,0	09-30	(US)	040930	4,100,000	M	EUR	104,3457	97,921	4	4,017,932,27	4,017,932,27	42,153,01	17,331,20	1,74					
FR0014010N23	LEGAND	1,5	06-33	(US)	230633	6,100,000	M	EUR	102,7864	108,737	4	6,269,972,71	6,658,207,00	25,250,00	388,234,29	3,08						
XS2938556573	MERR	LY	0,1	04-30	(999)	280430	4,000,000	M	EUR	99,9503	95,7515	4	3,998,011,11	3,831,648,89	1,588,89	-166,362,22	1,77					

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi, pri notai au 30/09/25
PORTFOLLE : 000500 LBPAMI SR CONVERTIBLES OPPORTUNITES
Devise de fin ng : FRF Devises Reuters
Devise du portefeuille : EUR
(Etat simplifie, trame : FC3 TR AM/TYRE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE, Tris : B/L04)

V A L E U R		STATUTS	DOSSIER	QUANTITE	DEV	P R U EN DEVISE	DATE	COURS	I	FR X REV ENT	TOTA	VALEUR BOURS	CAPON	COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	PROT		
VALUATION		VALUATION	EXPR	QUANTITE	COT	ET EXPR	COURS	COTA	VALEUR	F	FR X REV ENT	TOTA	VALEUR BOURS	BEE	CAPON	COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	ACT NET
DE000A2YF6	MTU AER 0.05 03-27	MPU V	1318400633	2,500,000.	M EUR	89.322	%30/09/25	114.0455	4	2,233,050.13	2,851,815.58	678.08	618,765.45	1.32				
XS2161819722	NEX 1.75 04-27	(366) 180327	1,700,000.	M EUR	111.6772	%30/09/25	114.0455	4	1,888,513.15	1,939,234.60	461.10	40,721.45	0.90					
DE000A351M2	NCR AG 4.25 04-30	(UST) 240427	7,000,000.	M EUR	111.0214	%30/09/25	97.282	4	7,771,499.12	6,863,626.61	53,886.61	-907,872.51	3.18					
FR001400N10	CFRPAR 2.0 02-31	(UST) 140430	2,400,000.	M EUR	123.4224	%30/09/25	159.9065	4	2,962,136.63	3,885,411.74	47,655.74	923,275.11	1.80					
XS276552598	PI RELI C ZCP 12-25	(366) 070231	2,000,000.	M EUR	99.1607	%30/09/25	95.7445	4	1,983,213.90	1,940,862.60	25,972.60	-42,351.30	0.90					
DE000A30M9B	PAG SRI 1.875 11-29	(999) 221225	2,000,000.	M EUR	93.37	%30/09/25	103.0405	4	1,867,400.00	2,060,810.00	0.00	193,410.00	0.95					
DE000A352B5	PAG SRI 2.25 11-30	(UST) 161129	2,200,000.	M EUR	100.	%30/09/25	104.138	4	2,200,000.00	2,306,616.84	15,580.84	106,616.84	1.07					
DE000A30V6T1	PAG SRI F ZCP 06-26	(UST) 281130	3,700,000.	M EUR	106.361	%30/09/25	105.2645	4	3,935,357.18	3,923,516.80	28,730.30	-11,840.38	1.82					
DE000A30V6T1	PAG SRI F ZCP 06-26	(999) 170626	1,500,000.	M EUR	102.18	%30/09/25	98.501	4	1,532,700.00	1,477,515.00	0.00	-55,185.00	0.68					
BE327660591	SARERR ZCP 04-26	(UST) 070230	1,300,000.	M EUR	535.912	%30/09/25	640.293	4	6,966,866.51	8,328,280.09	4,451.09	1,361,403.58	3.85					
XS267538493	SAI PEM 2.875 09-29	(999) 010426	4,000,000.	M EUR	101.25	%30/09/25	98.625	4	4,050,000.00	3,945,000.00	0.00	-105,000.00	1.83					
FR0014012V2	SCH EL 1.25 09-33	(UST) 110929	3,000,000.	M EUR	113.7332	%30/09/25	151.405	4	3,411,995.21	4,547,153.45	5,003.45	1,135,158.24	2.10					
FR001400R16	SCH EL 1.625 06-31	(UST) 230933	3,000,000.	M EUR	100.475	%30/09/25	101.109	4	3,014,280.00	3,033,995.14	725.14	19,745.14	1.40					
		MPU V CR321709127	500,000.	M EUR	100.	%30/09/25	106.409	4	500,000.00	1,068,352.30	2,131.15	34,176.15	0.25					
		PRETERIT 7/2202142	1,000,000.	M EUR	100.	%30/09/25	106.409	4	1,000,000.00	1,068,352.30	4,282.30	68,352.30	0.49					
FR001400M9	SCH EL 1.97 11-30	(UST) 280631	1,700,000.	M EUR	115.8192	%30/09/25	128.201	4	6,022,596.38	6,702,083.30	7,245.90	116,198.90	0.84					
XS2713344195	SI MD G 3.5 11-26	(UST) 141126	4,000,000.	M EUR	104.167	%30/09/25	123.2085	4	4,166,679.88	4,981,981.30	53,641.30	815,301.42	2.31					
FR001400F2K3	SRI E 2.0 01-28	(UST) 170128	2,500,000.	M EUR	117.2182	%30/09/25	145.0935	4	2,930,454.41	3,637,799.46	10,461.96	707,345.05	1.68					
DE000A40F57	TAG I MM0.625 03-31	(UST) 110331	4,000,000.	M EUR	104.2154	%30/09/25	104.712	4	4,168,615.23	4,189,930.28	1,450.28	21,315.05	1.94					
DE000A383JQ7	TUI AG 1.95 07-31	(UST) 280731	3,500,000.	M EUR	117.9489	%30/09/25	115.629	4	4,128,211.18	4,059,626.41	12,611.41	-68,594.77	1.88					
FR001400XEO	VINI 0.7 02-30	(UST) 180230	4,700,000.	M EUR	101.7054	%30/09/25	103.8905	4	4,780,155.67	4,986,876.60	4,023.10	106,720.93	2.26					
DE000A40M7K	VNDMA SE ZCP 05-30	(999) 200530	8,900,000.	M EUR	101.5303	%30/09/25	98.847	4	9,036,200.00	8,797,383.00	976.03	-143,173.29	0.45					
DE000A3E4597	ZALA SE 0.625 08-27	(366) 060827	1,000,000.	M EUR	110.6599	%30/09/25	96.245	4	1,106,599.32	963,426.03	615,577.45	8,960,867.34	83.87					
SOLS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO																		
CMLL (EUR)																		
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US																		
DE000A4EF8U1	Q AG IN 2.0 09-32	(EXA) 040932	2,000,000.	M USD	100.	%30/09/25	99.1565	4	1,713,722.63	1,690,381.69	2,611.48	-23,340.94	0.78					
DE000A3L0619	Q AG IN 2.5 09-31	(UST) 100931	7,400,000.	M USD	101.6556	%30/09/25	101.983	4	6,797,325.96	6,432,327.74	9,568.59	-364,998.22	2.98					
XS2211997239	STM IN ZCP 08-27	(999) 040827	17,400,000.	M USD	98.2001	%30/09/25	98.4985	4	16,063,342.30	14,596,160.85	0.00	-1,477,181.45	6.75					
SOLS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US																		
CMLL (EUR)																		
24,574,390.89																		
22,708,870.28																		
12,180.07																		
-1,865,520.61																		
10.51																		
AUTRES OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHÉ REGLEMENTE																		
OBLIGATIONS FIX TO FLOAT																		
DEVISE VALEUR : EUR EURO																		
FR00140112G1	TE 4.0 PERP	(UST) 311299	3,500,000.	M EUR	102.55	%30/09/25	117.769	4	3,589,260.00	4,121,585.33	-329.67	532,335.33	1.91					
-OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES																		
CMLL (EUR)																		
200,439,551.91																		
208,067,233.97																		
627,427.85																		
7,627,662.06																		
96.28																		

Stock : Stock adm. p.ri. nci pal au 30/09/25
PORTFOLIO : 000500 LBPAMI SR CONVERTIBLES OPPORTUNITES

VAL. VAL. DEE

Devise de fixation : FRF Devises Reuters
Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifié, trame : FC3 TR AM/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE, Tris : B/A/L04)

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

V A L E U R	SITUAUS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P R U EN DEVISE	DATE	COURS	I	FR X REV EN TOTALE	VAL. BUR BOURSEE	COURON COUR. TOTALE	PLUS OU MOINS VAL	PROT
	VAL. LIQUE		QUANTITE	COT	ET BUR	COURS	COTA	VAL. BUR	F				ACT NET

III - TITRES D OPC

OPCVM ET EQUIVALENTS D AUTRES ETATS MEMBRE DE L UE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0013188752	CST	ISR OSH ECN ZZ	20	P BUR	10616.7	M 30/09/25	10713.75	5	212.334.00	214.275.00	0.00	1.941.00	0.10
FR0010392951	CST	ISM SR CASH M	470	P BUR	10723.5162	M 30/09/25	10733.59	5	5.040.052.62	5.044.787.30	0.00	4.734.88	2.33
FR0012750461	CST	ISM SR CASH Z	819	P BUR	10663.3935	M 30/09/25	10708.28	5	8.733.319.25	8.770.081.32	0.00	36.762.07	4.06
Sous total Devise Valeur : EUR EURO									13.985.705.87	14.029.143.62	0.00	43.437.75	6.49

IV - OPERATIONS TEMPORAIRES SUR TITRES
CREANCE REPRESENTATIVE DE TITRES FINANCIERS PRETES

DATE ECHEANCE : 04/01/49

FI/T/2202142	SCN	EL 1.625 06-31	PRET 0.75	040149	1.092.700		0	% 30/09/25	0.00	1.547.99	1.547.99	1.547.99	0.00
FI/T/2214112	ELR	NV 1.5 05-32	PRET 0.7	040149	1.235.760		0	% 30/09/25	0.00	961.15	961.15	961.15	0.00
Sous total Date Echeance : 04/01/49										2.509.14	2.509.14	2.509.14	

TITRES FINANCIERS DONNES EN PENSION (dont SBB)

DATE ECHEANCE : 04/01/49

1317693052	Q TI	CL 0.8 02-30	MU V -0.5	040149	-697.900		100	% 30/09/25	-697.900.00	-701.056.19	-3.156.19	-3.156.19	-0.32
1318400633	MTU	AGR 0.05 03-27	MU V -4.1	040149	-2.840.000		100	% 30/09/25	-2.840.000.00	-2.824.204.47	15.795.53	15.795.53	-1.31
1318754928	CAR	CB FI X 12-30	MU V -0.75	040149	-297.000		100	% 30/09/25	-297.000.00	-297.881.13	-881.13	-881.13	-0.14
1320937499	ELR	NV 1.5 05-32	MU V -0.65	040149	-1.860.588		100	% 30/09/25	-1.860.588.00	-1.862.827.06	-2.239.06	-2.239.06	-0.86
CR1321709127	SCN	EL 1.625 06-31	MU V -0.75	040149	-526.550		100	% 30/09/25	-526.550.00	-526.704.70	-154.70	-154.70	-0.24
Sous total Date Echeance : 04/01/49									-6.222.038.00	-6.212.673.55	9.364.45	9.364.45	-2.87

IV - OPERATIONS TEMPORAIRES SUR TITRES

QML (EUR)

-6.222.038.00

-6.210.164.41

11.873.59

11.873.59 -2.87

VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME

ENGAGEMENTS A TERME FERMES

FUTURES SUR OBLIGATIONS

Sous-jacent : EUOGE EUREX BOBL EURO

FR001000019R

ELR BOBL 1225

51

ELR

117.8

M 30/09/25

117.81

4

0.00

510.00

0.00

510.00 0.00

FR001000019X

ELR BUND 1225

29

ELR

127.89

M 30/09/25

128.57

4

0.00

19.720.00

0.00

19.720.00 0.01

FUTURES SUR OBLIGATIONS

QML (EUR)

0.00

20.230.00

0.00

20.230.00 0.01

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock adm. pri. not. pal. au 30/09/25
Devise de fixation : FRF
Devise du portefeuille : EUR
Devise du portefeuille : EUR
(Etat simplifié, trame : FC23 TR AM/TYRE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE, Tris : B/A/L04)

V A L E U R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P R U EN DEVISE	DATE	COUPS	I	FR X REV ENTOTA	VAL EUR BOURS EEE	COURON COUR TOGA	PLUS OU MOINS VAL	ACT NET
VAU/LIQUIDE	EXPR	QUANTITE	COT	ET EXPR	COUPS	COTA	VAL EUR	F	FR X REV ENTOTA	VAL EUR BOURS EEE	COURON COUR TOGA	PLUS OU MOINS VAL	ACT NET

FUTURES SUR DEVISES

SOUS-JACENT : CMEEC EUR/USD CME

FXL000002Y5 EC ELRUSD 1225 78. USD 1.1786 M30/09/25 1.1792 4 0.00 4,978.72 0.00 4,978.72 0.00

SOUS-JACENT : CMEHP EUR/GBP CME

FXL000002Y1 RP ELRGBP 1225 -9. GBP 0.8692 M30/09/25 0.87665 4 0.00 -9,602.72 0.00 -9,602.72 0.00

FUTURES SUR DEVISES

CMML (EUR)

-4,624.00

0.00

-4,624.00

FUTURES SUR INDICES

SOUS-JACENT : SXSE EURO STOXX 50

FIN0000008UWELRPO STOX 50 1225 -40. ELR 5520.425 M30/09/25 5541. 4 0.00 -8,230.00 0.00 -8,230.00 0.00

ENGAGEMENTS A TERME FERMEES

CMML (EUR)

0.00

0.00

7,376.00

ENGAGEMENTS A TERME CONDITIONNELS

OPTIONS SUR ACTIONS- MARCHE REGLEMENTE

SOUS-JACENT : DE00DEVNK013 EYONIK INDUSTRIES AG

CEQJ00004354 EYON K 251219 C17 500. P ELR 0.99 M30/09/25 0.1 4 49,500.00 5,000.00 0.00 -44,500.00 0.00

SOUS-JACENT : FR0000121014 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI

CEQJ000041AK LVMH M 250619 C560 25. P ELR 24. M30/09/25 34.91 4 60,000.00 87,275.00 0.00 27,275.00 0.04

SOUS-JACENT : NL0000226223 STMICROELECTRONICS NV

CEQJ00003LPN STM GR 250619 C28 200. P ELR 1.9183 M30/09/25 1.76 4 38,366.00 35,200.00 0.00 -3,166.00 0.02

OPTIONS SUR ACTIONS- MARCHE REGLEMENTE

CMML (EUR)

147,866.00

0.00

-20,391.00 0.06

OPTIONS SUR INDICES - MARCHE REGLEMENTE

SOUS-JACENT : SXSE EURO STOXX 50

CJN00001RCY ELRPO S 251219 P5100 130. P ELR 252.6657 M30/09/25 47. 4 328,465.43 61,100.00 0.00 -267,365.43 0.03

CJN00001X5Y ELRPO S 251219 C5450 210. P ELR 161.4 M30/09/25 206.5 4 338,940.00 433,650.00 0.00 94,710.00 0.20

CJN00001X5Z ELRPO S 251219 P5450 210. P ELR 196.1 M30/09/25 115.9 4 411,810.00 243,390.00 0.00 -168,420.00 0.11

SOUS TOTAL SOUS-JACENT : SXSE EURO STOXX 50

CMML (EUR)

1,079,215.43

0.00

-341,075.43 0.34

ENGAGEMENTS A TERME CONDITIONNELS

CMML (EUR)

1,227,081.43

866,615.00

0.00

-361,466.43 0.40

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock adm. p.ri. nci. pal. au 30/09/25
Devise de fixation : FRF
Devise du portefeuille : EUR
Devise des Reuters (Etat simplifié, trame : FC3 TR AM/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE, Tris : B/A/L04)

V A L E U R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P R U EN DEVISE	DATE	COUPS	I	<----->	Devise du portefeuille	----->	PROT
	VALUATION		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COUPS	COTA	VAL. EUR	F	FR X REA. BNT. TOA	VAL. EUR BOURSÉE	COURON COUR. TOA	PLUS OU MOINS VAL. ACT. NET

VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME

CMML (EUR)

1,227,081.43

872,991.00

0.00

-364,090.43 0.40

VII - AUTRES ENGAGEMENTS

DERIVES DE CREDIT

CREDIT DEFAULT SWAP (CDS)

DATE ECHEANCE : 20/06/30

DOR16992741 | TRXX ELRDE 5Y SA3 | VPROT 20/06/30 | 986,660 | ELR | -1,3056 | %30/09/25 | 10,781994 | M | -12,881.39 | 107,614.95 | 1,233.33 | 120,496.34 | 0.05

DOR16992742 | TRXX ELRDE 5Y SA3 | VPROT 20/06/30 | 1,973,320 | ELR | -1,3056 | %30/09/25 | 10,781994 | M | -25,762.79 | 215,229.89 | 2,466.65 | 240,992.68 | 0.10

SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 20/06/30

CMML (EUR)

-38,644.18

322,844.84

3,699.98

361,489.02 0.15

IX - TRESORERIE

DETTES ET CREANCES

REGLEMENTS DIFFERES

DEVISE VALEUR : EUR EURO

ARBEUR | Ach. rgt. différé | -4,102,000. | ELR | 1, | 30/09/25 | 1, | -4,102,000.00 | -4,102,000.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | -1.90

VABEUR | V. rgt. différé | 1,805,820.08 | ELR | 1, | 30/09/25 | 1, | 1,805,820.08 | 1,805,820.08 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.84

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CMML (EUR)

-2,296,179.92

-2,296,179.92

0.00

0.00 -1.06

COUPONS ET DIVIDENDES EN ESPECES

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FF0000130095 | REM. CO NIVEAU | 157. | P. ELR | 1,5 | 30/09/25 | A | 235.50 | 235.50 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00

COLLATERAL CASH SUR DERIVES LISTES

DEVISE VALEUR : EUR EURO

DQAO EUR | Dépôt gar. CACEIS BK | 222,667.83 | ELR | 1, | 30/09/25 | 1, | 222,667.83 | 222,667.83 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.10

COLLATERAL CASH OTC

DEVISE VALEUR : EUR EURO

639BE4640+00 | COLLAT. JEFFERES | -160,000. | ELR | 1, | 30/09/25 | 1, | -160,000.00 | -160,196.76 | -196.76 | -196.76 | -0.07

COLLATERAL CASH SUR PRETEMPRUNT

DEVISE VALEUR : EUR EURO

578BE4640+00 | COLOYS+78BE4640+00 | 160,000. | ELR | 1, | 30/09/25 | 1, | 160,000.00 | 160,156.10 | 156.10 | 156.10 | 0.07

585BE4640+00 | COLOYS+85BE4640+00 | -2,413,000. | ELR | 1, | 30/09/25 | 1, | -2,413,000.00 | -2,416,870.05 | -3,870.05 | -3,870.05 | -1.12

592BE4640+00 | COLOYS+92BE4640+00 | -210,000. | ELR | 1, | 30/09/25 | 1, | -210,000.00 | -210,336.81 | -336.81 | -336.81 | -0.10

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CMML (EUR)

-2,463,000.00

-2,467,050.76

-4,050.76

-4,050.76 -1.14

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock adm. p.ri. nci. pal. au 30/09/25
PORTFOLIO : 000500 LBPAMI SR CONVERTIBLES OPPORTUNITES
Devise de fixation : FRF
Devise du portefeuille : EUR
(Etat simplifié, trame : FC23 TR AMF TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE, Tris : B/L04)

V A L E U R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P R U EN DEVISE	DATE	COURS	I	<----->	Devise du portefeuille	----->	PROT				
	VALUATION		EXPR QUANTITE	COT	ET EXPR	COURS	COTA	VAL EUR	F	FR X REVENIR	TOTA	VAL EUR BOUTEE	COURON	COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	ACT NET

APPELS DE MARGE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

MARGO EUR Appel Marge CACEIS -12,000. EUR 1. 30/09/25 1. -12,000.00 -12,000.00 0.00 0.00 -0.01

DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING

MARGO GBP Appel Marge CACEIS 8,381.24 GBP 1,148,512.63 30/09/25 1,145,737.86 9,625.96 9,602.70 0.00 -23.26 0.00

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

MARGO USD Appel Marge CACEIS -5,850. USD 0,85106496 30/09/25 0,85106383 -4,978.73 -4,978.72 0.00 0.01 0.00

APPELS DE MARGE

CUMUL (EUR) -7,352.77 -7,376.02 0.00 -23.25

FRAIS DE GESTION

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FOAMFEUR Prov. coti. sat. ion AMF -1,417.65 EUR 1. 30/09/25 1. -1,417.65 -1,417.65 0.00 0.00 0.00

FOVAFDEUR Frais de Gest. Fixe -17,788.17 EUR 1. 30/09/25 1. -17,788.17 -17,788.17 0.00 0.00 -0.01

FOVAFDEUR Frais de Gest. Fixe -76,335.58 EUR 1. 30/09/25 1. -76,335.58 -76,335.58 0.00 0.00 -0.04

FOVAFDEUR Frais de Gest. Fixe -21,788.07 EUR 1. 30/09/25 1. -21,788.07 -21,788.07 0.00 0.00 -0.01

FOVAFDEUR Frais de Gest. Fixe -14,707.87 EUR 1. 30/09/25 1. -14,707.87 -14,707.87 0.00 0.00 -0.01

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR) -132,037.34 -132,037.34 0.00 0.00 -0.06

AUTRES DETTES ET CREANCES

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FRECEUR frais des recherche -16,638.2 EUR 1. 30/09/25 1. -16,638.20 -16,638.20 0.00 0.00 -0.01

DETTES ET CREANCES

CUMUL (EUR) -4,852,304.90 -4,856,575.67 -4,247.52 -4,270.77 -2.25

DISPONIBILITES

AVOIRS

DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE

BOD CHF CACEIS Bank 14,633.88 CHF 1,048,601.6 30/09/25 1,069,903.2 15,345.11 15,653.72 0.00 308.61 0.01

DEVISE VALEUR : EUR EURO

BOD EUR CACEIS Bank -84,349.97 EUR 1. 30/09/25 1. -84,349.97 -84,349.97 0.00 0.00 -0.04

DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING

BOD GBP CACEIS Bank -8,155.83 GBP 1,148,018.04 30/09/25 1,145,737.86 -9,363.04 -9,344.44 0.00 18.60 0.00

DEVISE VALEUR : HKD DOLLAR DE HONG-KONG

BOD HKD CACEIS Bank -10.2 HKD 0,12058824 30/09/25 0,10938525 -1.23 -1.12 0.00 0.11 0.00

DEVISE VALEUR : MXN NOUVEAU PESO MEXICAIN

BOD MXN CACEIS Bank -16,766. MXN 0,05489681 30/09/25 0,04642375 -920.40 -778.34 0.00 142.06 0.00

DEVISE VALEUR : SGD DOLLAR DE SINGAPOUR

V A L E U R		STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P R U EN DEVISE	DATE	COUPS	I	<-----	Devise du portefeuille	----->	PROT
		VAU/LIQU		EXR QUANTITE	COT	ET EXR COUPS	COTA	VALEUR	F	FR X REVENIR TOTA	VALEUR BOUTS ETE	COURON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL ACT NET
BOD SGD	CACEIS Bank			18,861.9	SGD	0.56825081	30/09/25	0.66015316		10,718.29	12,451.74	0.00	1,733.45 0.01
DEUISE VALEUR : USD DOLLAR US													
BOD USD	CACEIS Bank			94,483.88	USD	0.85344061	30/09/25	0.85106383		80,636.38	80,411.81	0.00	-224.57 0.04
AVOIRS													
IX - TRESORERIE													
CUMUL (EUR)													
-4,840,239.76													
-4,842,532.27													
-4,247.52													
-2,292.51 -2.24													
PORTFEUILLE : LBPAMI SR CONVERTIBLES OPPORTUNITES (000SCO)													
(EUR)													
208,944,503.71													
216,097,341.85													
638,753.90													
7,152,838.14 100.00													

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock adm. p.ri. nci pal au 30/09/25
PORTEFUILLER : 000500 LBPAMI SR CONVERTIBLES OPPORTUNITES
Devise de fin. xing : FRF
Devise du portefeuille : EUR
Devise simplifiée, trame : FC23 TR AMF TYPE INSTRUMENT/ ORDRE ALPHABETIQUE, Tris : B/A/L04)

Portefeuille titres :		220,939,874.12	Coupons et dividendes à recevoir :		235.5			
Frais de gestion du jour								
Prov cotisation AMF :		5.57	EUR					
Frais de Gest. Fixe :		570.26	EUR					
Frais de Gest. Fixe :		2,405.17	EUR					
Frais de Gest. Fixe :		686.71	EUR					
Frais de Gest. Fixe :		501.92	EUR					
Frais de recherche :		180.85	EUR					
Frais de gestion charge Entreprise								
Frais maximum :		570.26	EUR					
Frais maximum :		2,405.17	EUR					
Frais maximum :		686.71	EUR					
Frais maximum totale :		501.92	EUR					
Part								
Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff. resultat	Change	Prix std Souscrit.	Prix std Rechat
D1 FR0011640903 LBPAMI SR CONV/CP I	EUR	34,689,923.26	2,481,760.65	13,977.94	16.0528986382		13,977.94	13,977.94
D2 FR0011640911 LBPAMI SR CONV/CP L	EUR	73,154,681.04	55,823,901.88	1,310.45	33.853112639168		1,310.45	1,310.45
D3 FR0012129690 LBPAMI SR CONV/CP X	EUR	71,612,856.55	5,035,256.49	14,222.28	33.138945082455		15,075.61	14,222.28
D5 FR001400PEV8 LBPAMI SR CONV/CP J	EUR	36,639,881.00	3,192	11,478.65	16.955172414557		11,478.65	11,478.65
D4 FR0013453669 LBPAMI SR CONV/CP P	EUR	0.00	0	100.00	0.		0.00	0.00
Actif net total en EUR :		216,097,341.85						
Precedente VL en date du 29/09/25 :								
D1	LBPAMI SR CONV/CP I	Prec. VL :	13,960.97	(EUR)	Variation :	+0.122%		
D2	LBPAMI SR CONV/CP L	Prec. VL :	1,308.88	(EUR)	Variation :	+0.120%		
D3	LBPAMI SR CONV/CP X	Prec. VL :	14,204.91	(EUR)	Variation :	+0.122%		
D5	LBPAMI SR CONV/CP J	Prec. VL :	11,464.69	(EUR)	Variation :	+0.122%		
VL theorique								
Part	Devise	Actif theorique	Valeur liquidative theorique					
D1 FR0011640903 LBPAMI SR CONV/CP I	EUR	34,689,923.26	13,977.94	1,310.45				
D2 FR0011640911 LBPAMI SR CONV/CP L	EUR	73,154,681.04	1,310.45	14,222.28				
D3 FR0012129690 LBPAMI SR CONV/CP X	EUR	71,612,856.55	14,222.28	11,478.65				
D5 FR001400PEV8 LBPAMI SR CONV/CP J	EUR	36,639,881.00	11,478.65	0.				

Actif théorique total en EUR :	216,097,341,85	(Sens collécté : EQU)
--------------------------------	----------------	-----------------------

