Rapport semestriel

au 30 juin 2026

LBPAM FUNDS compartiment :

LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI

Action M, Action I, Action E, Action GP, Action I2, Action L

FORME JURIDIQUE DE L'OPC
SICAV de droit français

CLASSIFICATION
N/A

AFFECTATION DES RÉSULTATS
La SICAV est un OPCVM à compartiments.
Les actions L sont des actions de capitalisation et/ou de distribution, les actions E, GP, I, I2, L et M sont des actions de capitalisation et/ou de distribution et/ou de report. Elles pourront recourir à la distribution d'acomptes.
L'assemblée générale de la SICAV statue chaque année sur l'affectation des résultats et 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

- Le 17/02/2026 : Changement de dénomination : LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI ; Suppression de l'action MH n'étant plus souscrite.

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	0,43 %
Montant des titres engagés dans des opérations de prêt de titres	1 435 677,50 euros soit 0,43 % de l'actif net
Données sur la concentration	
Les 10 plus gros émetteurs de garantie	—
Les 10 principales contreparties pour les opérations de prêt de titres	JEFFERIES GMBH
Données d'opération agrégées (opérations de prêts de titres)	
Type, qualité et monnaie des garanties	Cash collateral en Euro
Échéance des titres sous-jacents	
Échéance des opérations	1 jour
Pays des contreparties	Allemagne
Règlement et compensation	Billatéral
Données sur la réutilisation des garanties	
Part des garanties reçues qui est réutilisée	100 %
Revenus pour l'OPC	7 151,36
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 %
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 : 73 301 euros (67 % des revenus) Gestionnaire de l'OPC : 36 104 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	314 705 614,28
b) Avoirs bancaires	2 782 101,71
c) Autres actifs détenus par l'OPC	20 664 883,77
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	338 152 599,76
e) Passif	-2 414 155,33
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	335 738 444,43

(*) Les montants sont signés

NOMBRE D'ACTIONS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

Action	Type d'action	Actif net de l'action	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action
LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI E en EUR	C/D/R	42 064 249,90	228 252,07340	184,28
LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI GP en EUR	C/D/R	1 215 811,64	9 553,35529	127,26
LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI I en EUR	C/D/R	52 822 488,69	2 918,97364	18 096,25
LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI I2 en EUR	C/D/R	84 762 898,09	6 821,31997	12 426,17
LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI L en EUR	C/D/R	6 786 318,89	5 903,96848	1 149,45
LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI M en EUR	C/D/R	148 086 677,22	710 534,05263	208,41

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.	81,75	81,17
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.	11,98	11,90
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.	4,47	4,44

(*) 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	289 000 556,39	86,08	85,46
Dollar Us	USD	25 705 057,89	7,66	7,60
TOTAL		**314 705 614,28**	**93,74**	**93,07**

(*) 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	33,28	33,04
ALLEMAGNE	24,25	24,08
PAYS-BAS	14,58	14,48
ETATS-UNIS	7,50	7,45
ESPAGNE	6,83	6,78
JERSEY	2,36	2,34
SUISSE	2,12	2,11
LUXEMBOURG	1,48	1,47
ITALIE	1,33	1,32
TOTAL	**93,74**	**93,07**

(*) 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	4,47	4,44
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	**4,47**	**4,44**

(*) 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.	98 315 689,90	91 532 660,27
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.	27 808 169,12	45 183 204,79
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.	131 274 644,83	128 268 821,27

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

	Action	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
	LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI E			
	LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI GP			
	LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI I			
	LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI I2			
	LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI L			
	LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI M			
Dividendes à verser				
	LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI E			
	LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI GP			
	LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI I			
	LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI I2			
	LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI L			
	LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI M			

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Code ISIN	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ACTIONS ET VALEURS ASSIMILÉES				**1 009 740,14**	**0,30**
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				**1 009 740,14**	**0,30**
Conglomérats industriels				**965 737,50**	**0,29**
RHEINMETALL AG	DE0007030009	EUR	975	965 737,50	0,29
Semi-conducteurs et équipements pour fabrication				**44 002,64**	**0,01**
STMICROELECTRONICS NV	NL0000226223	EUR	682	44 002,64	0,01
OBLIGATIONS CONVERTIBLES EN ACTIONS				**313 695 874,14**	**93,44**
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé				**313 695 874,14**	**93,44**
Banques commerciales				**23 158 212,00**	**6,90**
BNP PAR ZCP 19-02-31 CV	FR001400QC44	EUR	13 300 000	14 242 837,00	4,25
JPMORGAN CHASE BANK NA 0.1% 12-01-29	XS3233492233	EUR	2 000 000	1 950 140,00	0,58
JPMORGAN CHASE BANK NA ZCP 31-12-31	XS3342050617	EUR	6 200 000	6 965 235,00	2,07
Electricité				**16 968 103,25**	**5,05**
LEGRAND 1.5% 23-06-33 CV	FR0014010NZ3	EUR	14 600 000	16 968 103,25	5,05
Equipement et services pour l'énergie				**4 457 725,00**	**1,33**
SAIPEM 2.875% 11-09-29 CV	XS2677538493	EUR	1 600 000	4 457 725,00	1,33
Equipements électriques				**30 746 274,65**	**9,16**
SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.25% 30-09-34	FR00140190M5	EUR	24 400 000	24 846 636,67	7,40
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.625% 28-06-31 CV	FR001400R1R6	EUR	5 000 000	5 899 637,98	1,76
Gestion et promotion immobilière				**10 891 281,74**	**3,24**
LEG PROPERTIES BV 1.0% 04-09-30	DE000A3L21D1	EUR	11 200 000	10 891 281,74	3,24
Gestion immobilière et développement				**43 419 056,99**	**12,94**
TAG IMMOBILIEN AG 0.625% 11-03-31	DE000A4DFC57	EUR	9 900 000	10 672 092,66	3,18
VONOVIA SE 0.0% 30-06-31 CV	DE000A46ZZU0	EUR	4 500 000	4 614 862,50	1,37
VONOVIA SE 0.875% 20-05-32 CV	DE000A4DFHL5	EUR	11 300 000	10 735 648,83	3,20
VONOVIA SE ZCP 20-05-30 CV	DE000A4DFHK7	EUR	18 100 000	17 396 453,00	5,19
Hôtels, restaurants et loisirs				**11 204 283,65**	**3,34**
ACCOR 0.7% 07-12-27 CV	FR0013521085	EUR	161 716	9 784 384,01	2,92
SPIE 2.0% 17-01-28 DD	FR001400F2K3	EUR	900 000	1 419 899,64	0,42
Industrie aérospatiale et défense				**11 518 146,50**	**3,43**
MTU AERO ENGINES ZCP 15-07-33	DE000A46Z7S3	EUR	11 300 000	11 518 146,50	3,43
Logiciels				**15 861 837,07**	**4,72**
VINCI 0.7% 18-02-30 CV	FR001400XE50	EUR	10 800 000	11 712 342,53	3,48
VINCI 0.75% 04-03-31 CV EMTN	FR0014016PI1	EUR	4 200 000	4 149 494,54	1,24
Machines				**7 915 404,00**	**2,36**
GOLDMAN SACHS FINANCE CORP INTL ZCP 07-05-30	XS2958341708	EUR	4 200 000	7 915 404,00	2,36
Marchés de capitaux				**19 183 596,75**	**5,71**
CARA OBLIGATIONS SAS 1.5% 01-12-30	FR0014010U53	EUR	7 400 000	8 529 599,08	2,54
CITIGROUP GLOBAL MKTS FUNDING ZCP 15-03-28 CV	XS2566032095	EUR	4 700 000	4 984 561,50	1,48
JP MORGAN CHASE FINANCIAL COMPANY LLC 0.1% 20-05-30	XS3076174393	EUR	400 000	376 628,67	0,11
JP MORGAN CHASE FINANCIAL COMPANY LLC 0.5% 27-03-30	XS3041309207	EUR	4 500 000	5 292 807,50	1,58
Métaux et minerais				**13 223 907,60**	**3,94**
RAG STIFTUNG 1.45% 16-12-31 CV	DE000A460KE7	EUR	1 700 000	1 739 574,10	0,52
RAG STIFTUNG 1.875% 16-11-29	DE000A30VPN9	EUR	3 800 000	4 165 197,86	1,24
RAG STIFTUNG 2.25% 28-11-30 CV	DE000A352B25	EUR	6 600 000	7 319 135,64	2,18
Outils et services appliqués aux sciences biologiques				**18 625 271,31**	**5,55**
QIAGEN NV 2.0% 04-09-32 CV	DE000A4EF8U1	USD	7 600 000	6 575 900,11	1,96

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Code ISIN	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
QIAGEN NV 2.5% 10-09-31 CV	DE000A3L06J9	USD	13 600 000	12 049 371,20	3,59
Semi-conducteurs et équipements pour fabrication				**7 079 786,58**	**2,11**
STMICROELECTRONICS NV ZCP 23-06-31	XS3416917022	USD	8 000 000	7 079 786,58	2,11
Services aux collectivités				**10 473 611,45**	**3,12**
IBERDROLA FINANZAS SAU 0.8% 07-12-27 CV	XS2557565830	EUR	4 500 000	7 495 431,52	2,23
VEOLIA ENVIRONNEMENT 0.75% 02-01-32	FR0014019DN1	EUR	3 000 000	2 978 179,93	0,89
Services aux entreprises				**1 030 728,12**	**0,31**
ELIS EX HOLDELIS 2.25% 22-09-29	FR001400AFJ9	EUR	600 000	1 030 728,12	0,31
Services de télécommunication diversifiés				**15 422 310,30**	**4,59**
CELLNEX TELECOM 0.75% 20-11-31 CV	XS2257580857	EUR	16 900 000	15 422 310,30	4,59
Services financiers diversifiés				**30 049 055,07**	**8,95**
CITIGROUP GLOBAL MKTS 0.8% 05-02-30 CV	XS2982266343	EUR	7 900 000	8 677 098,65	2,58
CITIGROUP GLOBAL MKTS 1.0% 09-04-29 CV	XS2782912518	EUR	2 000 000	1 927 281,92	0,57
EURONEXT NV 1.5% 30-05-32 CV	IT0006769316	EUR	10 800 000	11 239 561,17	3,36
FERROVIAL SE 0.75% 20-05-31 CV	XS3168182692	EUR	6 500 000	6 826 560,00	2,03
MERRILL LYNCH BV 0.1% 28-04-30 CV	XS2938565673	EUR	1 500 000	1 378 553,33	0,41
Sociétés commerciales et de distribution				**10 178 469,61**	**3,03**
REXEL 1.0% 13-05-31 CV	FR0014016E65	EUR	9 800 000	10 178 469,61	3,03
Soins et autres services médicaux				**12 288 812,50**	**3,66**
FRESENIUS SE 0.0% 11-03-28 CV	DE000A4DFSR9	EUR	12 500 000	12 288 812,50	3,66
TITRES D'OPC				**15 013 440,30**	**4,47**
OPCVM				**15 013 440,30**	**4,47**
Gestion collective				**15 013 440,30**	**4,47**
OSTRUM SRI CASH Part M	FR0010392951	EUR	1 377,59217	15 013 440,30	4,47
TITRES FINANCIERS DONNÉS EN PENSION				**1 435 677,50**	**0,43**
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé				**1 435 677,50**	**0,43**
Industrie aérospatiale et défense				**305 791,50**	**0,09**
MTU AERO ENGINES ZCP 15-07-33	DE000A46Z7S3	EUR	300 000	305 791,50	0,09
Marchés de capitaux				**1 129 886,00**	**0,34**
JP MORGAN CHASE FINANCIAL COMPANY LLC 0.1% 20-05-30	XS3076174393	EUR	1 200 000	1 129 886,00	0,34
DETTES REPRÉSENTATIVES DES TITRES DONNÉS EN PENSION				**-1 407 300,00**	**-0,42**
INDEMNITÉS SUR TITRES DONNÉS EN PENSION				**-234,12**	**0,00**
TOTAL				**329 747 197,96**	**98,22**

(*) 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 0926	-63	0,00	-20 110,00	-4 004 280,00
Sous-total 1.		**0,00**	**-20 110,00**	**-4 004 280,00**
2. Options				
EURO STOXX 50 12/2026 CALL 6300	490	1 589 560,00	0,00	17 488 309,52
EURO STOXX 50 12/2026 PUT 6300	490	1 220 590,00	0,00	-13 395 300,91
LVMH MOET HENNE 12/2026 CALL 600	1 200	131 598,00	0,00	1 185 076,80
SCHNEIDER ELECTR 12/2026 CALL 300	130	290 940,00	0,00	1 795 736,80
Sous-total 2.		**3 232 688,00**	**0,00**	**7 073 822,21**
3. Swaps				
Sous-total 3.		**0,00**	**0,00**	**0,00**
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		**0,00**	**0,00**	**0,00**
TOTAL		**3 232 688,00**	**-20 110,00**	**3 069 542,21**

(*) 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.

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				
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 - 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				
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 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 d'action

Type d'opération	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)				Classe de part couverte
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)		
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)	
A/EUR/CHF/20260723	34,99	0,00	EUR	14 242,81	CHF	-14 207,82	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
A/EUR/USD/20260723	0,00	-17 773,56	EUR	4 263 520,20	USD	-4 281 293,76	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
A/EUR/USD/20260723	0,00	-149 527,06	EUR	9 503 874,20	USD	-9 653 401,26	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
A/EUR/USD/20260723	0,00	-13 797,89	EUR	4 376 489,69	USD	-4 390 287,58	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
A/EUR/USD/20260723	0,00	-4 023,27	EUR	965 487,89	USD	-969 511,16	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
A/EUR/USD/20260723	0,00	-2 003,85	EUR	1 531 420,71	USD	-1 533 424,56	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
A/EUR/USD/20260723	0,00	-41 915,87	EUR	2 664 154,44	USD	-2 706 070,31	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
A/EUR/USD/20260723	0,00	-1 212,38	EUR	926 544,82	USD	-927 757,20	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
A/EUR/USD/20260723	0,00	-77 558,38	EUR	4 929 576,90	USD	-5 007 135,28	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
A/EUR/USD/20260723	0,00	-1 940,64	EUR	123 346,34	USD	-125 286,98	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
V/EUR/USD/20260723	22 386,02	0,00	USD	1 383 039,74	EUR	-1 360 653,72	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
V/EUR/USD/20260723	93 934,47	0,00	USD	5 803 404,35	EUR	-5 709 469,88	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
V/EUR/USD/20260723	1 263,22	0,00	USD	1 128 849,39	EUR	-1 127 586,17	FR0010130807 FR0010617357 FR0013262490 FR0013448818
TOTAL	**117 618,70**	**-309 752,90**		**37 613 951,48**		**-37 806 085,68**	

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

Synthèse de l'inventaire

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	329 747 197,96
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	3 212 578,00
Total instruments financiers à terme - taux	0,00
Total instruments financiers à terme - change	0,00
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	-192 134,20
Autres actifs (+)	3 647 560,98
Autres passifs (-)	-676 758,31
Passifs de financement (-)	0,00
TOTAL = ACTIF NET	**335 738 444,43**

Libellé de l'action	Devise de l'action	Nombre d'actions	Valeur liquidative
Action LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI E	EUR	228 252,07340	184,28
Action LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI GP	EUR	9 553,35529	127,26
Action LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI I	EUR	2 918,97364	18 096,25
Action LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI I2	EUR	6 821,31997	12 426,17
Action LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI L	EUR	5 903,96848	1 149,45
Action LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI M	EUR	710 534,05263	208,41

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 26/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 000SCE LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<---------- Devise du portefeuille PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL ---------->	PRCT ACT NET
0 -ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES												
ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE OU ASSIMILE												
ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE OU ASSIMILE												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
DE0007030009 RHEINMETALL AG		975.	P EUR	1232.8	M 26/06/26	946.6	T	1,201,980.00	922,935.00	0.00	-279,045.00	0.28
NL0000226223 STMICROELECTRONI		682.	P EUR	66.4	M 26/06/26	62.6	T	45,284.80	42,693.20	0.00	-2,591.60	0.01
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO												
						CUMUL (EUR)		1,247,264.80	965,628.20	0.00	-281,636.60	0.29
I -OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES												
OBLIGATIONS CONVERTIBLES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE												
OBLIGATIONS CONVERTIBLES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
DE000A30VPN9 RAG STI 1.875 11-29	(UST) 161129	3,800,000.	M EUR	108.6277	% 26/06/26	109.763	4	4,127,851.62	4,179,706.64	8,712.64	51,855.02	1.25
DE000A352B25 RAG STI 2.25 11-30	(UST) 281130	6,600,000.	M EUR	105.2365	% 26/06/26	111.1275	4	6,945,608.11	7,347,731.58	13,316.58	402,123.47	2.20
DE000A3L21D1 LEG PRO 1.0 09-30	(UST) 040930	11,200,000.	M EUR	105.7999	% 26/06/26	96.963	4	11,849,588.56	10,895,769.04	35,913.04	-953,819.52	3.26
DE000A460KE7 RAG STI 1.45 12-31	(UST) 161231	1,700,000.	M EUR	100.	% 26/06/26	102.63	4	1,700,000.00	1,745,652.90	942.90	45,652.90	0.52
DE000A46Z7S3 MTU AERO E ZCP 07-33	MPLIV IOC128827521	300,000.	M EUR	100.6746	% 26/06/26	101.4275	4	302,023.78	304,282.50	0.00	2,258.72	0.09
	(999) 150733	11,300,000.	M EUR	100.6746	% 26/06/26	101.4275	4	11,376,229.22	11,461,307.50	0.00	85,078.28	3.43
DE000A4DFC57 TAG IMM 0.625 03-31	(UST) 110331	9,900,000.	M EUR	105.6279	% 26/06/26	107.6435	4	10,457,164.32	10,675,369.88	18,663.38	218,205.56	3.19
DE000A4DFHK7 VONOVIA SE ZCP 05-30	(999) 200530	18,100,000.	M EUR	102.6682	% 26/06/26	96.102	4	18,582,952.61	17,394,462.00	0.00	-1,188,490.61	5.20
DE000A4DFHL5 VONO SE 0.875 05-32	(UST) 200532	11,300,000.	M EUR	97.1112	% 26/06/26	94.953	4	10,973,569.97	10,740,704.96	11,015.96	-232,865.01	3.21
DE000A4DFSR9 FRES SE 0.0 03-28	(366) 110328	12,500,000.	M EUR	102.2107	% 26/06/26	99.0815	4	12,776,340.00	12,385,187.50	0.00	-391,152.50	3.70
FR0013521085 ACCOR 0.7 12-27	(UST) 071227	161,716.	P EUR	51.0652	M 26/06/26	59.983	4	8,258,055.31	9,700,210.83	29,997.14	1,442,155.52	2.90
FR001400AFJ9 ELIS EX 2.25 09-29	(366) 220929	600,000.	M EUR	126.3518	% 26/06/26	172.22	4	758,110.59	1,043,713.15	10,393.15	285,602.56	0.31
FR001400F2K3 SPIE 2.0 01-28	(UST) 170128	900,000.	M EUR	108.4204	% 26/06/26	159.448	4	975,783.61	1,443,186.70	8,154.70	467,403.09	0.43
FR001400QC44 BNP PAR ZCP 02-31	(999) 190231	13,300,000.	M EUR	101.691	% 26/06/26	106.669	4	13,524,900.00	14,186,977.00	0.00	662,077.00	4.24
FR001400R1R6 SCHN EL 1.625 06-31	(UST) 280631	5,000,000.	M EUR	101.8959	% 26/06/26	116.0205	4	5,094,796.31	5,840,984.02	39,959.02	746,187.71	1.75
FR001400XE50 VINCI 0.7 02-30	(UST) 180230	10,800,000.	M EUR	105.0905	% 26/06/26	109.2965	4	11,349,776.00	11,831,588.85	27,566.85	481,812.85	3.54
FR0014010NZ3 LEGRAND 1.5 06-33	(UST) 230633	14,600,000.	M EUR	101.9363	% 26/06/26	115.131	4	14,882,706.58	16,813,314.52	4,188.52	1,930,607.94	5.03
FR0014010U53 CARA OB 1.5 12-30	(UST) 011230	7,400,000.	M EUR	105.7446	% 26/06/26	120.108	4	7,825,103.28	8,895,573.97	7,581.97	1,070,470.69	2.66
FR0014016E65 REXEL 1.0 05-31	(UST) 130531	9,800,000.	M EUR	103.1567	% 26/06/26	102.588	4	10,109,360.54	10,065,341.39	11,717.39	-44,019.15	3.01
FR0014016PI1 VINCI 0.75 03-31	(UST) 040331	4,200,000.	M EUR	98.9753	% 26/06/26	98.7405	4	4,156,962.23	4,156,859.15	9,758.15	-103.08	1.24
FR00140190M5 SCHN EL 0.25 09-34	(UST) 300934	24,400,000.	M EUR	100.134	% 26/06/26	100.5125	4	24,432,694.51	24,527,550.00	2,500.00	94,855.49	7.33
FR0014019DN1 VEOL EN 0.75 01-32	(366) 020132	3,000,000.	M EUR	100.	% 26/06/26	99.1715	4	3,000,000.00	2,975,206.64	61.64	-24,793.36	0.89
IT0006769316 EURO NV 1.5 05-32	(UST) 300532	10,800,000.	M EUR	103.213	% 26/06/26	104.106	4	11,147,000.93	11,257,094.74	13,646.74	110,093.81	3.37
XS2257580857 CELL TE 0.75 11-31	(366) 201131	16,900,000.	M EUR	90.5953	% 26/06/26	90.817	4	15,310,597.86	15,425,164.78	77,091.78	114,566.92	4.61
XS2557565830 IBER FI 0.8 12-27	(UST) 071227	4,500,000.	M EUR	101.8832	% 26/06/26	165.3405	4	4,584,743.20	7,442,584.80	2,262.30	2,857,841.60	2.23
XS2566032095 CITI GLOB ZCP 03-28	(999) 150328	4,700,000.	M EUR	102.6744	% 26/06/26	106.559	4	4,825,699.00	5,008,273.00	0.00	182,574.00	1.50
XS2677538493 SAIPEM 2.875 09-29	(UST) 110929	1,600,000.	M EUR	117.4001	% 26/06/26	263.84	4	1,878,401.51	4,235,315.00	13,875.00	2,356,913.49	1.27
XS2782912518 CITI GL 1.0 04-29	(366) 090429	2,000,000.	M EUR	100.4835	% 26/06/26	96.205	4	2,009,669.12	1,928,812.33	4,712.33	-80,856.79	0.58
XS2938565673 MERR LY 0.1 04-30	(999) 280430	1,500,000.	M EUR	97.6759	% 26/06/26	91.92	4	1,465,138.46	1,379,062.50	262.50	-86,075.96	0.41
XS2958341708 GOLD SACH ZCP 05-30	(999) 070530	4,200,000.	M EUR	102.2362	% 26/06/26	175.857	4	4,293,918.46	7,385,994.00	0.00	3,092,075.54	2.21
XS2982266343 CITI GL 0.8 02-30	(366) 050230	7,900,000.	M EUR	102.9204	% 26/06/26	108.9035	4	8,130,714.88	8,628,483.35	25,106.85	497,768.47	2.58
XS3041309207 JP MORG 0.5 03-30	(EUR) 270330	4,500,000.	M EUR	105.1734	% 26/06/26	116.4375	4	4,732,801.83	5,245,500.00	5,812.50	512,698.17	1.57
XS3076174393 JP MORG 0.1 05-30	MPLIV IOC129198675	1,200,000.	M EUR	100.0003	% 26/06/26	93.6585	4	1,200,003.34	1,124,035.33	133.33	-75,968.01	0.34

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 26/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 000SCE LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<---------- Devise du portefeuille PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL ---------->	PRCT ACT NET
		(EUR) 200530	400,000.	M EUR	100.0003	% 26/06/26	93.6585	4	400,001.11	374,678.44	44.44	-25,322.67	0.11
XS3168182692 FERR SE 0.75 05-31		(EUR) 200531	6,500,000.	M EUR	101.3675	% 26/06/26	105.8295	4	6,588,884.66	6,884,334.17	5,416.67	295,449.51	2.06
XS3233492233 JPMO CH 0.1 01-29		(EUR) 120129	2,000,000.	M EUR	100.	% 26/06/26	97.2915	4	2,000,000.00	1,946,718.89	888.89	-53,281.11	0.58
XS3342050617 JPMO CHAS ZCP 12-31		(999) 311231	6,200,000.	M EUR	106.4538	% 26/06/26	109.804	4	6,600,138.00	6,807,848.00	0.00	207,710.00	2.04
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO													
						CUMUL (EUR)			268,627,289.51	283,684,580.05	389,696.36	15,057,290.54	84.83
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US													
DE000A3L06J9 QIAG NV 2.5 09-31		(UST) 100931	13,600,000.	M USD	101.7454	% 26/06/26	100.814	4	12,435,248.50	12,123,020.85	90,810.23	-312,227.65	3.63
DE000A4EF8U1 QIAG NV 2.0 09-32		(EXA) 040932	7,600,000.	M USD	100.2691	% 26/06/26	98.6025	4	6,541,498.82	6,619,508.32	43,123.94	78,009.50	1.98
XS3416917022 STMI NV ZCP 06-31		(999) 230631	8,000,000.	M USD	101.0285	% 26/06/26	99.8515	4	6,993,600.44	7,010,197.46	0.00	16,597.02	2.10
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US													
						CUMUL (EUR)			25,970,347.76	25,752,726.63	133,934.17	-217,621.13	7.70
OBLIGATIONS CONVERTIBLES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE													
						CUMUL (EUR)			294,597,637.27	309,437,306.68	523,630.53	14,839,669.41	92.53
III - TITRES D OPC													
OPCVM ET EQUIVALENTS D AUTRES ETATS MEMBRE DE L UE													
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
FR0010392951 OSTRUM SRI CASH M			1,741.34414	P EUR	10888.0416	M 28/06/26	10896.91	5	18,959,827.39	18,975,270.37	0.00	15,442.98	5.67
IV -OPERATIONS TEMPORAIRES SUR TITRES													
TITRES FINANCIERS DONNES EN PENSION (dont SBB)													
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
IOC128827521 MTU AERO E ZCP 07-33	MPLIV -2.5	030128	-286,500.	EUR	100.	% 26/06/26			-286,500.00	-286,433.86	66.14	66.14	-0.09
IOC129198675 JP MORG 0.1 05-30	MPLIV -1.5	030128	-1,120,800.	EUR	100.	% 26/06/26			-1,120,800.00	-1,121,025.53	-225.53	-225.53	-0.34
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO													
						CUMUL (EUR)			-1,407,300.00	-1,407,459.39	-159.39	-159.39	-0.42
VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME													
ENGAGEMENTS A TERME FERMES													
FUTURES SUR INDICES													
DEVISE COTATION : EUR EURO													
FINL000009E0 EURO STOXX 50 0926			-243.	EUR	6338.393	M 26/06/26	6255.	4	0.00	202,645.00	0.00	202,645.00	0.06
ENGAGEMENTS A TERME CONDITIONNELS													
OPTIONS SUR ACTIONS- MARCHE REGLEMENTE													
DEVISE COTATION : EUR EURO													
OEQL00004F9E SCHNEI 261218 C300			130.	P EUR	14.8	M 26/06/26	18.52	4	192,400.00	240,760.00	0.00	48,360.00	0.07
OEQL00004GN3 LVMH M 261218 C600			1,200.	P EUR	17.5546	M 26/06/26	13.7657	4	210,654.60	165,188.40	0.00	-45,466.20	0.05
SOUS TOTAL DEVISE COTATION : EUR EURO													
						CUMUL (EUR)			403,054.60	405,948.40	0.00	2,893.80	0.12

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 26/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 000SCE LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<---------- Devise du portefeuille PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	----------> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
OPTIONS SUR INDICES - MARCHE REGLEMENTE												
DEVISE COTATION : EUR EURO												
OINL000021PS EURO S 260918 C5900		490.	P EUR	269.5	M 26/06/26	439.9	4	1,320,550.00	2,155,510.00	0.00	834,960.00	0.64
OINL000021PT EURO S 260918 P5900		490.	P EUR	348.7	M 26/06/26	86.8	4	1,708,630.00	425,320.00	0.00	-1,283,310.00	0.13
SOUS TOTAL DEVISE COTATION : EUR EURO												
					CUMUL (EUR)			3,029,180.00	2,580,830.00	0.00	-448,350.00	0.77
ENGAGEMENTS A TERME CONDITIONNELS												
					CUMUL (EUR)			3,432,234.60	2,986,778.40	0.00	-445,456.20	0.89
VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME												
					CUMUL (EUR)			3,432,234.60	3,189,423.40	0.00	-242,811.20	0.95
IX - TRESORERIE												
DETTES ET CREANCES												
REGLEMENTS DIFFERES												
ARDEUR Ach rglt différé		-3,000,000.	EUR	1.	26/06/26	1.		-3,000,000.00	-3,000,000.00	0.00	0.00	-0.90
IPRCIEUR Indemnite Pret diff		47,082.9	EUR	1.	26/06/26	1.		47,082.90	47,082.90	0.00	0.00	0.01
IPRCIUSD Indemnite Pret diff		7,287.24	USD	0.86404318	26/06/26	0.87757789		6,296.49	6,395.12	0.00	98.63	0.00
RACHEUR Rachats a payer		-5,036.83	EUR	1.	26/06/26	1.		-5,036.83	-5,036.83	0.00	0.00	0.00
SOUSEUR Souscriptions/payer		2,445,852.84	EUR	1.	26/06/26	1.		2,445,852.84	2,445,852.84	0.00	0.00	0.73
VRDEUR Vte rglt différé		1,087,437.52	EUR	1.	26/06/26	1.		1,087,437.52	1,087,437.52	0.00	0.00	0.33
REGLEMENTS DIFFERES												
					CUMUL (EUR)			581,632.92	581,731.55	0.00	98.63	0.17
COUPONS ET DIVIDENDES EN ESPECES												
IT0006769316 EURO NV 1.5 05-32		41.	P EUR	750.	26/06/26		A	30,750.00	30,750.00	0.00	0.00	0.01
NL0000226223 STMICROELECTRONI		682.	P USD	0.0764956	26/06/26		A	45.58	45.78	0.00	0.20	0.00
COUPONS ET DIVIDENDES EN ESPECES												
					CUMUL (EUR)			30,795.58	30,795.78	0.00	0.20	0.01
COLLATERAL CASH OTC												
CCOTC0000YI7 CC/OTC/CHASDEFXXXX		390,000.	EUR	1.	26/06/26	1.		390,000.00	390,000.00	0.00	0.00	0.12
COLLATERAL CASH SUR PRET/EMPRUNT												
585BE4337+00 COLCASH585BE4337+00		280,000.	EUR	1.	26/06/26	1.		280,000.00	280,304.80	304.80	304.80	0.08
605BE4337+00 COLLAT SG		-280,000.	EUR	1.	26/06/26	1.		-280,000.00	-280,470.03	-470.03	-470.03	-0.08
COLLATERAL CASH SUR PRET/EMPRUNT												
					CUMUL (EUR)			0.00	-165.23	-165.23	-165.23	
APPELS DE MARGE												
MARCIEUR Appel Marge CACEIS		-202,645.	EUR	1.	26/06/26	1.		-202,645.00	-202,645.00	0.00	0.00	-0.06

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 26/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 000SCE LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<---------- Devise du portefeuille PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	----------> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
FRAIS DE GESTION												
FGAMFEUR Prov cotisation AMF		-1,329.95	EUR	1.	26/06/26	1.		-1,329.95	-1,329.95	0.00	0.00	0.00
FGPVFD1EUR Frais de Gest. Fixe		-39,317.42	EUR	1.	26/06/26	1.		-39,317.42	-39,317.42	0.00	0.00	-0.01
FGPVFD2EUR Frais de Gest. Fixe		-27,316.58	EUR	1.	26/06/26	1.		-27,316.58	-27,316.58	0.00	0.00	-0.01
FGPVFD3EUR Frais de Gest. Fixe		-19,221.25	EUR	1.	26/06/26	1.		-19,221.25	-19,221.25	0.00	0.00	-0.01
FGPVFD5EUR Frais de Gest. Fixe		-727.95	EUR	1.	26/06/26	1.		-727.95	-727.95	0.00	0.00	0.00
FGPVFD6EUR Frais de Gest. Fixe		-45,138.75	EUR	1.	26/06/26	1.		-45,138.75	-45,138.75	0.00	0.00	-0.01
FGPVFD7EUR Frais de Gest. Fixe		-6,241.17	EUR	1.	26/06/26	1.		-6,241.17	-6,241.17	0.00	0.00	0.00
FRAIS DE GESTION												
					CUMUL (EUR)			-139,293.07	-139,293.07	0.00	0.00	-0.04
AUTRES DETTES ET CREANCES												
FRECEUR frais des recherche		-32,599.63	EUR	1.	26/06/26	1.		-32,599.63	-32,599.63	0.00	0.00	-0.01
RCOEUR Commission sur pret		-3,264.48	EUR	1.	26/06/26	1.		-3,264.48	-3,264.48	0.00	0.00	0.00
AUTRES DETTES ET CREANCES												
					CUMUL (EUR)			-35,864.11	-35,864.11	0.00	0.00	-0.01
DETTES ET CREANCES												
					CUMUL (EUR)			624,626.32	624,559.92	-165.23	-66.40	0.19
DISPONIBILITES												
AVOIRS												
BQCICHF CACEIS Bank		-6.54	CHF	1.04740061	26/06/26	1.08465752		-6.85	-7.09	0.00	-0.24	0.00
BQCIEUR CACEIS Bank		2,902,779.02	EUR	1.	26/06/26	1.		2,902,779.02	2,902,779.02	0.00	0.00	0.87
BQCIGBP CACEIS Bank		0.42	GBP	1.16666667	26/06/26	1.15834588		0.49	0.49	0.00	0.00	0.00
BQCIHUF CACEIS Bank		35.	HUF	0.00314286	26/06/26	0.00282646		0.11	0.10	0.00	-0.01	0.00
BQCISEK CACEIS Bank		-0.37	SEK	0.08108108	26/06/26	0.09022421		-0.03	-0.03	0.00	0.00	0.00
BQCISGD CACEIS Bank		0.55	SGD	0.61818182	26/06/26	0.678288		0.34	0.37	0.00	0.03	0.00
AVOIRS												
					CUMUL (EUR)			2,902,773.08	2,902,772.86	0.00	-0.22	0.87
CHANGE A TERME ET SWAP DE CHANGE												
DEVISE COTATION : CHF FRANC SUISSE												
ICAT0002GI9R A/EUR/CHF/20260723	RECU 23/07/26	14,263.5	EUR	0.9185	26/06/26	0.92019967		14,263.50	14,239.21	0.00	-24.29	0.00
	VERSE 23/07/26	-13,101.	CHF	1.	26/06/26	1.		-14,263.50	-14,212.89	0.00	50.61	0.00
SOUS TOTAL DEVISE COTATION : CHF FRANC SUISSE												
					CUMUL (EUR)			0.00	26.32	0.00	26.32	
DEVISE COTATION : USD DOLLAR US												
ICAT0002GQUF A/EUR/USD/20260723	RECU 23/07/26	4,936,738.4	EUR	1.1623	26/06/26	1.14067228		4,936,738.40	4,928,331.04	0.00	-8,407.36	1.47
	VERSE 23/07/26	-5,737,822.45	USD	1.	26/06/26	1.		-4,936,738.40	-5,021,644.61	0.00	-84,906.21	-1.50
ICAT0002GHV6 V/EUR/USD/20260723	RECU 23/07/26	1,585,062.03	USD	1.	26/06/26	1.		1,362,560.88	1,387,011.01	0.00	24,450.13	0.41
	VERSE 23/07/26	-1,362,560.88	EUR	1.1633	26/06/26	1.14091376		-1,362,560.88	-1,360,324.06	0.00	2,236.82	-0.41
ICAT0002GI6U V/EUR/USD/20260723	RECU 23/07/26	6,651,114.67	USD	1.	26/06/26	1.		5,717,472.56	5,820,068.32	0.00	102,595.76	1.74
	VERSE 23/07/26	-5,717,472.56	EUR	1.1633	26/06/26	1.14091376		-5,717,472.56	-5,708,086.61	0.00	9,385.95	-1.71
ICAT0002GI9Q A/EUR/USD/20260723	RECU 23/07/26	123,525.53	EUR	1.1623	26/06/26	1.14067228		123,525.53	123,315.16	0.00	-210.37	0.04
	VERSE 23/07/26	-143,570.	USD	1.	26/06/26	1.		-123,525.53	-125,650.02	0.00	-2,124.49	-0.04
ICAT0002GJSJ A/EUR/USD/20260723	RECU 23/07/26	2,668,024.82	EUR	1.1623	26/06/26	1.14067228		2,668,024.82	2,663,481.12	0.00	-4,543.70	0.80

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 26/06/26 — Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 000SCE LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI — VL VALIDEE — Devise du portefeuille : EUR — (Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<---------- Devise du portefeuille PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	----------> PRCT PLUS OU MOINS VAL	ACT NET
	VERSE	23/07/26	-3,100,964.94	USD	1.	26/06/26	1.		-2,668,024.82	-2,713,911.77	0.00	-45,886.95	-0.81
ICAT0002GJU2 A/EUR/USD/20260723	RECU	23/07/26	9,517,681.07	EUR	1.1623	26/06/26	1.14067228		9,517,681.07	9,501,472.27	0.00	-16,208.80	2.84
	VERSE	23/07/26	-11,062,114.23	USD	1.	26/06/26	1.		-9,517,681.07	-9,681,374.22	0.00	-163,693.15	-2.89
ICAT0002GKG9 A/EUR/USD/20260723	RECU	23/07/26	966,890.51	EUR	1.149	26/06/26	1.14067228		966,890.51	965,243.88	0.00	-1,646.63	0.29
	VERSE	23/07/26	-1,110,991.13	USD	1.	26/06/26	1.		-966,890.51	-972,320.54	0.00	-5,430.03	-0.29
ICAT0002GLRA A/EUR/USD/20260723	RECU	23/07/26	4,382,847.69	EUR	1.1479	26/06/26	1.14067228		4,382,847.69	4,375,383.62	0.00	-7,464.07	1.31
	VERSE	23/07/26	-5,030,958.66	USD	1.	26/06/26	1.		-4,382,847.69	-4,403,009.44	0.00	-20,161.75	-1.32
ICAT0002GM3I A/EUR/USD/20260723	RECU	23/07/26	4,269,714.09	EUR	1.149	26/06/26	1.14067228		4,269,714.09	4,262,442.69	0.00	-7,271.40	1.27
	VERSE	23/07/26	-4,906,059.47	USD	1.	26/06/26	1.		-4,269,714.09	-4,293,699.80	0.00	-23,985.71	-1.28
ICAT0002GMTN A/EUR/USD/20260723	RECU	23/07/26	927,890.87	EUR	1.1458	26/06/26	1.14067228		927,890.87	926,310.65	0.00	-1,580.22	0.28
	VERSE	23/07/26	-1,063,144.05	USD	1.	26/06/26	1.		-927,890.87	-930,445.59	0.00	-2,554.72	-0.28
ICAT0002GMTQ V/EUR/USD/20260723	RECU	23/07/26	1,293,741.79	USD	1.	26/06/26	1.		1,129,166.65	1,132,090.79	0.00	2,924.14	0.34
	VERSE	23/07/26	-1,129,166.65	EUR	1.1457	26/06/26	1.14091376		-1,129,166.65	-1,127,312.98	0.00	1,853.67	-0.34
ICAT0002GMTZ A/EUR/USD/20260723	RECU	23/07/26	1,533,645.5	EUR	1.1458	26/06/26	1.14067228		1,533,645.50	1,531,033.67	0.00	-2,611.83	0.46
	VERSE	23/07/26	-1,757,195.96	USD	1.	26/06/26	1.		-1,533,645.50	-1,537,868.01	0.00	-4,222.51	-0.46
SOUS TOTAL DEVISE COTATION : USD DOLLAR US													
						CUMUL (EUR)			0.00	-259,463.43	0.00	-259,463.43	-0.08
CHANGE A TERME ET SWAP DE CHANGE													
						CUMUL (EUR)			0.00	-259,437.11	0.00	-259,437.11	-0.08
DISPONIBILITES													
						CUMUL (EUR)			2,902,773.08	2,643,335.75	0.00	-259,437.33	0.79
IX - TRESORERIE													
						CUMUL (EUR)			3,527,399.40	3,267,895.67	-165.23	-259,503.73	0.98
PORTEFEUILLE : LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI (000SCE)													
						(EUR)			320,357,063.46	334,428,064.93	523,305.91	14,071,001.47	100.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 26/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 000SCE LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

Portefeuille titres : 330,900,732.15 Coupons et dividendes a recevoir : 30,795.78

Frais de gestion du jour

Prov cotisation AMF :	8.61	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1,108.5	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1,622.99	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1,414.35	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1,009.3	EUR
Frais de Gest. Fixe :	26.21	EUR
Frais de Gest. Fixe :	222.21	EUR
frais des recherche :	374.71	EUR

Frais de gestion charge Entreprise

Frais maximum notice :	1,371.35	EUR
Frais maximum notice :	46.45	EUR
FRAIS GESTION MAX :	1,414.35	EUR
FRAIS GESTION MAX :	1,009.3	EUR
Frais maximum notice :	1,622.99	EUR
Frais maximum notice :	222.21	EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
D1 FR0010130807 LBPAM EUR CONV SRI M	EUR	147,495,417.53	710,534.05263	207.58	44.102484333456			207.58	207.58
D2 FR0010470609 LBPAM EUR CONV SRI I	EUR	52,626,470.01	2,918.97364	18,029.10	15.737969767123			18,029.10	18,029.10
D3 FR0010617357 LBPAM EUR CONV SRI E	EUR	41,710,626.07	227,225.06806	183.56	12.47207208631			183.56	183.56
D5 FR0013262490 LBPAM EUR CV SRI GP	EUR	1,211,015.71	9,553.35529	126.76	0.362109184477			134.36	126.76
D6 FR0013448818 LBPAM EUR CV SRI I2	EUR	84,625,739.59	6,837.31997	12,377.03	25.304115925919			12,377.03	12,377.03
D7 FR00140018M8 LBPAM EUR CONV SRI L	EUR	6,758,796.02	5,901.6021	1,145.24	2.021248702715			1,213.95	1,145.24

Actif net total en EUR : 334,428,064.93

Precedente VL en date du 25/06/26 :

D1	LBPAM EUR CONV SRI M	Prec. VL :	208.37	(EUR)	Variation :	-0.379%
D2	LBPAM EUR CONV SRI I	Prec. VL :	18,100.55	(EUR)	Variation :	-0.395%
D3	LBPAM EUR CONV SRI E	Prec. VL :	184.27	(EUR)	Variation :	-0.385%
D5	LBPAM EUR CV SRI GP	Prec. VL :	127.24	(EUR)	Variation :	-0.377%
D6	LBPAM EUR CV SRI I2	Prec. VL :	12,424.49	(EUR)	Variation :	-0.382%
D7	LBPAM EUR CONV SRI L	Prec. VL :	1,149.8	(EUR)	Variation :	-0.397%

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 26/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 000SCE LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

VL theorique

Part	Devise	Actif theorique	Valeur liquidative theorique
D1 FR0010130807 LBPAM EUR CONV SRI M	EUR	147,495,417.53	207.58
D2 FR0010470609 LBPAM EUR CONV SRI I	EUR	52,626,470.01	18,029.10
D3 FR0010617357 LBPAM EUR CONV SRI E	EUR	41,710,626.07	183.56
D5 FR0013262490 LBPAM EUR CV SRI GP	EUR	1,211,015.71	126.76
D6 FR0013448818 LBPAM EUR CV SRI I2	EUR	84,625,739.59	12,377.03
D7 FR00140018M8 LBPAM EUR CONV SRI L	EUR	6,758,796.02	1,145.24

Actif theorique total en EUR : 334,428,064.93 (Sens collecte : EQU)

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 26/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 000SCE LBPAM EUROPE CONVERTIBLES SRI VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

COURS DES DEVISES UTILISEES

	par la valorisation			par l'inventaire	par la valorisation précédente			variation
Cours EUR en CHF :	0.92195	cotation :	26/06/26	0.	0.9213	cotation :	25/06/26	0.07055
Cours EUR en EUR :	1.	cotation :	26/06/26	0.	1.	cotation :	25/06/26	0.
Cours EUR en GBP :	0.8633	cotation :	26/06/26	0.	0.8615	cotation :	25/06/26	0.20894
Cours EUR en HUF :	353.8	cotation :	26/06/26	0.	354.325	cotation :	25/06/26	-0.14817
Cours EUR en SEK :	11.0835	cotation :	26/06/26	0.	11.05055	cotation :	25/06/26	0.29818
Cours EUR en SGD :	1.4743	cotation :	26/06/26	0.	1.47385	cotation :	25/06/26	0.03053
Cours EUR en USD :	1.1395	cotation :	26/06/26	0.	1.13765	cotation :	25/06/26	0.16262

COURS INVERSES DES DEVISES UTILISEES

	par la valorisation			par l'inventaire	par la valorisation précédente		
Cours CHF en EUR :	1.0846575194	cotation :	26/06/26	0.	1.0854227722	cotation :	25/06/26
Cours EUR en EUR :	1.	cotation :	26/06/26	0.	1.	cotation :	25/06/26
Cours GBP en EUR :	1.1583458821	cotation :	26/06/26	0.	1.1607661056	cotation :	25/06/26
Cours HUF en EUR :	0.0028264556	cotation :	26/06/26	0.	0.0028222677	cotation :	25/06/26
Cours SEK en EUR :	0.0902242072	cotation :	26/06/26	0.	0.0904932334	cotation :	25/06/26
Cours SGD en EUR :	0.6782880011	cotation :	26/06/26	0.	0.6784950979	cotation :	25/06/26
Cours USD en EUR :	0.877577885	cotation :	26/06/26	0.	0.8790049664	cotation :	25/06/26