



Rapport semestriel

au 28 juin 2024

LBPAM ISR DIVERSIFIE PLUS

Part **AD**, Part **R**

FORME JURIDIQUE DE L'OPC

FCP de droit français

CLASSIFICATION

N/A

AFFECTATION DES RÉSULTATS

Le FCP est un FIA de capitalisation et/ou distribution et/ou de report avec possibilité de distribution d'acompte pour les parts AD et R.

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

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

Éléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique (*)
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-24-55 du code monétaire et financier	0,00
b) Avoirs bancaires	248 708,30
c) Autres actifs détenus par l'OPC	582 506 060,07
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	582 754 768,37
e) Passif	-8 380 169,36
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	574 374 599,01

(*) 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 DIVERSIFIE PLUS AD en EUR	D	108 167 852,92	960 991,00000	112,55
LBPAM ISR DIVERSIFIE PLUS R en EUR	D	466 206 746,09	3 960 121,94169	117,72

ÉLÉMENT DU PORTEFEUILLE TITRES

Éléments 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.	0,00	0,00
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 du fonds d'investissement à vocation générale.	0,00	0,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	100,10	98,66

(*) 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 (**)
NEANT				

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

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

RÉPARTITION 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 (**)
NEANT		

(*) 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	60,79	59,91
Autres OPC et fonds d'investissements	0,00	0,00
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	39,31	38,75
Autres	0,00	0,00
TOTAL	100,10	98,66

(*) 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 PÉRIODE 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.	0,00	0,00
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 du fonds d'investissement à vocation générale.	0,00	0,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214- 32-18 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	367 180 686,27	399 829 752,73

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Part		Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt (1) EUR	Montant brut unitaire (2) EUR	Montant éligible à réfaction EUR
Dividendes versés					
28/05/2024	LBPAM ISR DIVERSIFIE PLUS AD	0,73	0,00	0,73	0,00
Dividendes à verser					

L'abattement (réfaction) de 50 % jusqu'au 31/12/2005 et de 40 % à compter du 01/01/2006 ne s'applique qu'aux personnes physiques.

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
TITRES D'OPC			501 219 521,02	87,26
OPCVM			275 408 578,03	47,95
Gestion collective			275 408 578,03	47,95
ECQUER CRDT SRI EUROPE-IXL	EUR	17 032	17 265 508,72	3,01
iShares China Large Cap UCITS ETF USD (Dist)	EUR	179 831	12 651 578,41	2,20
ISHARES II PLC ISHARES EURO CORP BOND ESG UCITS ETF EUR DIS	EUR	10 187 715	47 254 697,26	8,23
ISHARES SUST MSCI EM SRI	EUR	3 051 821	20 245 170,15	3,52
LBPAM ACTIONS EURO LARGE CAP I	EUR	1 742	5 598 927,36	0,97
LBPAM ISR CONVERTIBLES OPPORTUNITES L	EUR	15 738	18 009 308,16	3,14
LBPAM Tocqueville Croissance Euro ISR Part I	EUR	5 914	34 048 021,66	5,93
OSTRUM SRI CASH Part M	EUR	5 246	54 358 737,24	9,46
OSTRUM SRI MONEY 6M PART I	EUR	1 391	15 221 518,26	2,65
TOCQUEVILLE EURO EQUITY ISR C	EUR	183 291	50 755 110,81	8,84
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne			225 810 942,99	39,31
Gestion collective			225 810 942,99	39,31
LBPAM ISR ACTIONS AMERIQUE C	EUR	199 225	20 255 205,75	3,53
LBPAM ISR Actions Focus Euro R	EUR	347 876	51 116 899,44	8,89
LBPAM ISR ACTIONS JAPON R	EUR	20 574	46 301 581,26	8,06
LBPAM ISR ACTIONS USA 500 R	EUR	222 602	49 277 404,74	8,58
LBPAM ISR MULTI ACTIONS EMERGENTS R	EUR	17 012	25 685 568,20	4,47
LBPAM ISR OBLIG JUILLET 2026 PART M	EUR	202 423	21 572 219,11	3,76
TOCQUEVILLE GLOBAL TECH ISR PART I	EUR	769	11 602 064,49	2,02
TITRES FINANCIERS MIS EN DÉPOSIT			73 743 933,54	12,84
OPCVM			73 743 933,54	12,84
Gestion collective			73 743 933,54	12,84
OSTRUM SRI MONEY 6M PART I	EUR	6 739	73 743 933,54	12,84
Total			574 963 454,56	100,10

(*) 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				
FTSE 100 FUT 0924	250	0,00	-47 178,16	24 214 188,83
Sous-total 1.		0,00	-47 178,16	24 214 188,83
2. Options				
CAC 40 09/2024 PUT 7000	-1 000	0,00	-979 400,00	16 155 504,00
CAC 40 09/2024 PUT 7400	500	942 050,00	0,00	-14 809 212,00
EURO STOXX 50 07/2024 PUT 4600	3 000	474 000,00	0,00	-17 324 830,80
EURO STOXX 50 07/2024 PUT 4750	-6 000	0,00	-2 232 000,00	74 291 223,60
EURO STOXX 50 07/2024 PUT 4900	3 000	2 499 000,00	0,00	-71 942 094,00
EURO STOXX 50 09/2024 CALL 5100	800	445 600,00	0,00	11 745 648,00
Sous-total 2.		4 360 650,00	-3 211 400,00	-1 883 761,20
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		4 360 650,00	-3 258 578,16	22 330 427,63

(*) 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 0924	240	259 200,00	0,00	27 945 600,00
EURO BUND 0924	860	1 418 800,00	0,00	113 193 200,00
LIFFE LG GILT 0924	300	0,00	-311 375,83	34 523 795,48
US 10YR NOTE 0924	225	170 573,83	0,00	23 089 791,82
Sous-total 1.		1 848 573,83	-311 375,83	198 752 387,30
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		1 848 573,83	-311 375,83	198 752 387,30

(*) 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 0924	150	75 886,40	0,00	18 810 356,89
RY EURJPY 0924	-350	0,00	-692 742,59	-43 361 303,86
Sous-total 1.		75 886,40	-692 742,59	-24 550 946,97
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		75 886,40	-692 742,59	-24 550 946,97

(*) 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 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)	574 963 454,56
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	1 102 071,84
Total instruments financiers à terme - taux	1 537 198,00
Total instruments financiers à terme - change	-616 856,19
Total instruments financiers à terme - crédit	0,00
Total instruments financiers à terme - autres expositions	0,00
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	0,00
Autres actifs (+)	1 506 203,58
Autres passifs (-)	-4 117 472,78
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	574 374 599,01

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part LBPAM ISR DIVERSIFIE PLUS AD	EUR	960 991,00000	112,55
Part LBPAM ISR DIVERSIFIE PLUS R	EUR	3 960 121,94169	117,72

LE DOCUMENT PÉRIODIQUE N'A PAS ÉTÉ CERTIFIÉ PAR LE COMMISSAIRE AUX COMPTES DE L'OPC