



# Composition de l'actif

au 31 décembre 2019

## FEDERIS PRO ACTIONS ISR EURO

Part MM, Part I

### FORME JURIDIQUE DE L'OPC

FCP de droit français

### CLASSIFICATION

Actions de pays de la zone euro

Document public

---

La Banque Postale Asset Management – 34, rue de la Fédération 75737 Paris Cedex 15

La Banque Postale Asset Management est une société de gestion agréée auprès de l'AMF sous le n° 95015 SA à Directoire et Conseil de Surveillance au capital de 5 368 107,80 euros – 344 812 615 RCS Paris

labanquepostale-am.fr

Désignation des valeurs	Quantité	Cours	Devise	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Disponibilités</b>					
Cash BP2S BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	3 870,3200		CHF	3 560,55	0,000
<b>TOTAL devise CHF</b>				<b>3 560,55</b>	<b>0,000</b>
Cash BP2S BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	-1 212 476,4800		DKK	-162 258,48	-0,050
<b>TOTAL devise DKK</b>				<b>-162 258,48</b>	<b>-0,050</b>
Appels de marge	-64 412,5000		EUR	-64 412,50	-0,020
Achats valeurs mob. à régler	-127 431,8300		EUR	-127 431,83	-0,040
Frais de recherche	-48 344,1600		EUR	-48 344,16	-0,010
Frais AMF à régler N-1	-2 012,9500		EUR	-2 012,95	0,000
Prov Frais AMF	-245,9500		EUR	-245,95	0,000
Prov frais gestion glob 13D	-9 100,9200		EUR	-9 100,92	0,000
Prov frais gestion glob 72D	-82 902,6600		EUR	-82 902,66	-0,020
Cash BP2S BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	493 939,4000		EUR	493 939,40	0,150
<b>TOTAL devise EUR</b>				<b>159 488,43</b>	<b>0,060</b>
Cash BP2S BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	-314 671,3900		GBP	-371 359,40	-0,110
<b>TOTAL devise GBP</b>				<b>-371 359,40</b>	<b>-0,110</b>
Cash BP2S BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	-366 560,6300		NOK	-37 162,40	-0,010
<b>TOTAL devise NOK</b>				<b>-37 162,40</b>	<b>-0,010</b>
Cash BP2S BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	89 390,5900		USD	79 635,27	0,020
<b>TOTAL devise USD</b>				<b>79 635,27</b>	<b>0,020</b>
<b>TOTAL Disponibilités</b>				<b>-328 096,03</b>	<b>-0,090</b>
<b>Futures</b>					
CAC40 EURO FUT 20/03/2020	-180,0000	5 963,00	EUR	-23 400,00	-0,010
DAX INDEX - FUTURE 20/03/2020	-1,0000	13 246,50	EUR	50,00	0,000
DAX INDEX - FUTURE 20/03/2020	-1,0000	13 246,50	EUR	50,00	0,000
DAX INDEX - FUTURE 20/03/2020	-8,0000	13 246,50	EUR	-400,00	0,000
DAX INDEX - FUTURE 20/03/2020	-2,0000	13 246,50	EUR	-100,00	0,000
DAX INDEX - FUTURE 20/03/2020	-1,0000	13 246,50	EUR	-50,00	0,000
DAX INDEX - FUTURE 20/03/2020	-13,0000	13 246,50	EUR	55 412,50	0,020
EURO STOXX 50 - FUTURE 20/03/2020	-346,0000	3 729,00	EUR	13 840,00	0,000
EURO STOXX 50 - FUTURE 20/03/2020	-346,0000	3 729,00	EUR	10 380,00	0,000
EURO STOXX 50 - FUTURE 20/03/2020	-565,0000	3 729,00	EUR	-5 650,00	0,000
EURO STOXX 50 - FUTURE 20/03/2020	-567,0000	3 729,00	EUR	-11 340,00	0,000
EURO STOXX 50 - FUTURE 20/03/2020	-138,0000	3 729,00	EUR	0,00	0,000
EURO STOXX 50 - FUTURE 20/03/2020	-38,0000	3 729,00	EUR	-380,00	0,000
EURO STOXX 50 - FUTURE 20/03/2020	-100,0000	3 729,00	EUR	26 000,00	0,010
<b>TOTAL devise EUR</b>				<b>64 412,50</b>	<b>0,020</b>
<b>TOTAL Futures</b>				<b>64 412,50</b>	<b>0,020</b>
<b>Garanties</b>					
AXA SA	-110 500,0000	25,11	EUR		0,000
LOREAL	-10 000,0000	264,00	EUR		0,000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	-10 000,0000	414,20	EUR		0,000
<b>TOTAL devise EUR</b>					<b>0,000</b>
<b>TOTAL Garanties</b>					<b>0,000</b>
<b>Options</b>					
PUT STOXX 600 UTILITIES FUT 20/03/20 310	136,0000	0,50	EUR	3 400,00	0,000
PUT STOXX 600 UTILITIES FUT 20/03/20 310	364,0000	0,50	EUR	9 100,00	0,000
CALL DAX INDEX - OPTION 20/03/2020 14500	2 000,0000	8,50	EUR	85 000,00	0,030
PUT STOXX 600 OIL&GAS 20/03/2020 280	-500,0000	0,90	EUR	-22 500,00	-0,010
PUT STOXX 600 FOOD AND BEVE 20/03/20 700	-525,0000	1,60	EUR	-42 000,00	-0,010
PUT STOXX 600 FOOD AND BEVE 20/03/20 700	-225,0000	1,60	EUR	-18 000,00	-0,010
CALL EURO STOXX 50 - 4 OPTIO 20/03/20 3700	1 000,0000	108,60	EUR	1 086 000,00	0,330
CALL EURO STOXX 50 - 3 OPTIO 20/03/20 3800	-2 000,0000	53,50	EUR	-1 070 000,00	-0,320
PUT EURO STOXX 50 - 8 OPTION 20/03/20 3400	129,0000	22,80	EUR	29 412,00	0,010
PUT EURO STOXX 50 - 9 OPTION 20/03/20 3400	59,0000	22,80	EUR	13 452,00	0,000

Désignation des valeurs	Quantité	Cours	Devise	Valeur actuelle	% Actif Net
PUT EURO STOXX 50 - 0 OPTION 20/03/20 3400	187,0000	22,80	EUR	42 636,00	0,010
PUT EURO STOXX 50 - 1 OPTION 20/03/20 3400	149,0000	22,80	EUR	33 972,00	0,010
PUT EURO STOXX 50 - 2 OPTION 20/03/20 3400	226,0000	22,80	EUR	51 528,00	0,020
CALL EURO STOXX 50 - 1 OPTIO 19/06/20 3900	1 200,0000	32,30	EUR	387 600,00	0,120
CALL EURO STOXX 50 - 2 OPTIO 19/06/20 3900	1 800,0000	32,30	EUR	581 400,00	0,170
PUT EURO STOXX 50 - 6 OPTION 19/06/20 1800	-350,0000	0,50	EUR	-1 750,00	0,000
PUT EURO STOXX 50 - 3 OPTION 19/06/20 1800	-350,0000	0,50	EUR	-1 750,00	0,000
PUT EURO STOXX 50 - 6 OPTION 19/06/20 2000	-200,0000	1,00	EUR	-2 000,00	0,000
PUT EURO STOXX 50 - 4 OPTION 19/06/20 2600	300,0000	7,50	EUR	22 500,00	0,010
PUT EURO STOXX 50 - 7 OPTION 19/06/20 2700	150,0000	9,90	EUR	14 850,00	0,000
PUT EURO STOXX 50 - 8 OPTION 19/06/20 2700	150,0000	9,90	EUR	14 850,00	0,000
PUT EURO STOXX 50 - 0 OPTION 19/06/20 2800	150,0000	13,10	EUR	19 650,00	0,010
PUT EURO STOXX 50 - 1 OPTION 19/06/20 2800	150,0000	13,10	EUR	19 650,00	0,010
PUT EURO STOXX 50 - 4 OPTION 18/06/21 2100	-72,0000	21,40	EUR	-15 408,00	0,000
PUT EURO STOXX 50 - 4 OPTION 18/06/21 2100	-60,0000	21,40	EUR	-12 840,00	0,000
PUT EURO STOXX 50 - 4 OPTION 18/06/21 2100	-68,0000	21,40	EUR	-14 552,00	0,000
PUT EURO STOXX 50 - 0 OPTION 18/06/21 2100	-200,0000	21,40	EUR	-42 800,00	-0,010
PUT EURO STOXX 50 - 4 OPTION 18/06/21 2200	-68,0000	26,30	EUR	-17 884,00	-0,010
PUT EURO STOXX 50 - 5 OPTION 18/06/21 2200	-72,0000	26,30	EUR	-18 936,00	-0,010
PUT EURO STOXX 50 - 5 OPTION 18/06/21 2200	-60,0000	26,30	EUR	-15 780,00	0,000
PUT EURO STOXX 50 - 0 OPTION 18/06/21 2200	-200,0000	26,30	EUR	-52 600,00	-0,020
PUT EURO STOXX 50 - 5 OPTION 18/06/21 2250	-600,0000	29,00	EUR	-174 000,00	-0,050
PUT EURO STOXX 50 - 7 OPTION 18/06/21 2250	-400,0000	29,00	EUR	-116 000,00	-0,030
PUT EURO STOXX 50 - 0 OPTION 18/06/21 2900	200,0000	94,40	EUR	188 800,00	0,060
PUT EURO STOXX 50 - 0 OPTION 18/06/21 2900	200,0000	94,40	EUR	188 800,00	0,060
PUT EURO STOXX 50 - 5 OPTION 18/06/21 3000	144,0000	112,40	EUR	161 856,00	0,050
PUT EURO STOXX 50 - 5 OPTION 18/06/21 3000	120,0000	112,40	EUR	134 880,00	0,040
PUT EURO STOXX 50 - 5 OPTION 18/06/21 3000	136,0000	112,40	EUR	152 864,00	0,050
PUT EURO STOXX 50 - 5 OPTION 18/06/21 3150	600,0000	145,20	EUR	871 200,00	0,260
PUT EURO STOXX 50 - 7 OPTION 18/06/21 3150	400,0000	145,20	EUR	580 800,00	0,170
PUT EURO STOXX 50 - 6 OPTION 18/12/20 2000	-1,0000	7,50	EUR	-75,00	0,000
PUT EURO STOXX 50 - 7 OPTION 18/12/20 2000	-399,0000	7,50	EUR	-29 925,00	-0,010
PUT EURO STOXX 50 - 4 OPTION 18/12/20 2000	-400,0000	7,50	EUR	-30 000,00	-0,010
PUT EURO STOXX 50 - 6 OPTION 18/12/20 2000	-400,0000	7,50	EUR	-30 000,00	-0,010
PUT EURO STOXX 50 - 2 OPTION 18/12/20 2000	-400,0000	7,50	EUR	-30 000,00	-0,010
PUT EURO STOXX 50 - 2 OPTION 18/12/20 2100	-300,0000	9,60	EUR	-28 800,00	-0,010
PUT EURO STOXX 50 - 2 OPTION 18/12/20 2100	-232,0000	9,60	EUR	-22 272,00	-0,010
PUT EURO STOXX 50 - 3 OPTION 18/12/20 2100	-168,0000	9,60	EUR	-16 128,00	0,000
PUT EURO STOXX 50 - 8 OPTION 18/12/20 2750	399,0000	39,30	EUR	156 807,00	0,050
PUT EURO STOXX 50 - 9 OPTION 18/12/20 2750	1,0000	39,30	EUR	393,00	0,000
PUT EURO STOXX 50 - 5 OPTION 18/12/20 2800	400,0000	43,50	EUR	174 000,00	0,050
PUT EURO STOXX 50 - 3 OPTION 18/12/20 2800	400,0000	43,50	EUR	174 000,00	0,050
PUT EURO STOXX 50 - 7 OPTION 18/12/20 2850	400,0000	48,10	EUR	192 400,00	0,060
PUT EURO STOXX 50 - 3 OPTION 18/12/20 2900	300,0000	53,10	EUR	159 300,00	0,050
PUT EURO STOXX 50 - 0 OPTION 18/12/20 2950	400,0000	58,70	EUR	234 800,00	0,070
CALL EURO STOXX 50 - 4 OPTIO 16/12/22 4000	1 500,0000	150,90	EUR	2 263 500,00	0,680
<b>TOTAL devise EUR</b>				<b>6 223 400,00</b>	<b>1,890</b>
<b>TOTAL Options</b>				<b>6 223 400,00</b>	<b>1,890</b>
<b>Actions et titres assimilés</b>					
ORSTED A/S	49 542,0000	689,00	DKK	4 568 007,76	1,370
NOVOZYMES A/S-B SHARES	81 626,0000	326,00	DKK	3 561 067,38	1,070
NOVO NORDISK A/S-B	94 255,0000	386,65	DKK	4 877 041,92	1,460
<b>TOTAL devise DKK</b>				<b>13 006 117,06</b>	<b>3,900</b>
UMICORE	91 279,0000	43,36	EUR	3 957 857,44	1,190
DEUTSCHE POST AG-REG	77 410,0000	34,01	EUR	2 632 714,10	0,790
DEUTSCHE TELEKOM AG- REG	423 647,0000	14,57	EUR	6 172 536,79	1,850
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	51 476,0000	92,20	EUR	4 746 087,20	1,420

Désignation des valeurs	Quantité	Cours	Devise	Valeur actuelle	% Actif Net
SAP SE	98 994,0000	120,32	EUR	11 910 958,08	3,570
SIEMENS AG-REG	74 492,0000	116,54	EUR	8 681 297,68	2,600
ALLIANZ SE-REG	40 942,0000	218,40	EUR	8 941 732,80	2,680
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	22 967,0000	263,00	EUR	6 040 321,00	1,810
ADIDAS AG	23 244,0000	289,80	EUR	6 736 111,20	2,020
KNORR-BREMSE AG	31 913,0000	90,75	EUR	2 896 104,75	0,870
ACCIONA SA	33 138,0000	93,80	EUR	3 108 344,40	0,930
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	218 055,0000	15,64	EUR	3 409 289,93	1,020
IBERDROLA SA	684 043,0000	9,18	EUR	6 279 514,74	1,880
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	169 088,0000	31,45	EUR	5 317 817,60	1,590
STORA ENSO OYJ-R SHS	309 852,0000	12,97	EUR	4 017 231,18	1,200
NESTE OYJ	193 186,0000	31,02	EUR	5 992 629,72	1,800
CREDIT AGRICOLE SA	350 453,0000	12,93	EUR	4 529 605,03	1,360
AIR LIQUIDE SA	46 118,0000	126,20	EUR	5 820 091,60	1,740
LOREAL	23 922,0000	264,00	EUR	6 315 408,00	1,890
SANOFI	138 380,0000	89,62	EUR	12 401 615,60	3,720
AXA SA	271 556,0000	25,11	EUR	6 818 771,16	2,040
DANONE	108 572,0000	73,90	EUR	8 023 470,80	2,400
IMERYS SA	69 085,0000	37,68	EUR	2 603 122,80	0,780
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	20 941,0000	414,20	EUR	8 673 762,20	2,600
MICHELIN (CGDE)	47 472,0000	109,10	EUR	5 179 195,20	1,550
KERING	9 587,0000	585,20	EUR	5 610 312,40	1,680
ESSILORLUXOTTICA	29 965,0000	135,80	EUR	4 069 247,00	1,220
SEB SA	26 760,0000	132,40	EUR	3 543 024,00	1,060
KLEPIERRE	109 215,0000	33,85	EUR	3 696 927,75	1,110
SCHNEIDER ELECTRIC SE	67 777,0000	91,50	EUR	6 201 595,50	1,860
VEOLIA ENVIRONNEMENT	179 097,0000	23,71	EUR	4 246 389,87	1,270
PLASTIC OMNIUM	122 497,0000	24,90	EUR	3 050 175,30	0,910
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	158 245,0000	36,50	EUR	5 775 942,50	1,730
CAPGEMINI SE	46 697,0000	108,90	EUR	5 085 303,30	1,520
DASSAULT SYSTEMES SA	41 060,0000	146,55	EUR	6 017 343,00	1,800
BNP PARIBAS	114 578,0000	52,83	EUR	6 053 155,74	1,810
ORANGE	369 130,0000	13,12	EUR	4 842 985,60	1,450
AMUNDI SA	57 316,0000	69,90	EUR	4 006 388,40	1,200
BUREAU VERITAS SA	166 821,0000	23,26	EUR	3 880 256,46	1,160
ALSTOM	139 480,0000	42,23	EUR	5 890 240,40	1,770
IPSEN	49 101,0000	79,00	EUR	3 878 979,00	1,160
LEGRAND SA	51 447,0000	72,64	EUR	3 737 110,08	1,120
GETLINK SE	246 268,0000	15,51	EUR	3 819 616,68	1,140
SPIE SA - W/I	165 428,0000	18,16	EUR	3 004 172,48	0,900
VALEO SA	70 295,0000	31,41	EUR	2 207 965,95	0,660
S.O.I.T.E.C.	30 442,0000	93,70	EUR	2 852 415,40	0,850
UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	31 540,0000	140,65	EUR	4 436 101,00	1,330
ERG SPA	132 212,0000	19,22	EUR	2 541 114,64	0,760
PRYSMIAN SPA	192 100,0000	21,49	EUR	4 128 229,00	1,240
KONINKLIJKE PHILIPS NV	169 662,0000	43,52	EUR	7 383 690,24	2,210
KONINKLIJKE DSM NV	32 787,0000	116,10	EUR	3 806 570,70	1,140
STMICROELECTRONICS NV	185 690,0000	23,97	EUR	4 450 989,30	1,330
AIRBUS SE	43 765,0000	130,48	EUR	5 710 457,20	1,710
UNILEVER NV	156 310,0000	51,23	EUR	8 007 761,30	2,400
ASML HOLDING NV	47 652,0000	263,70	EUR	12 565 832,40	3,770
ING GROEP NV	494 245,0000	10,69	EUR	5 282 490,56	1,580
<b>TOTAL devise EUR</b>				<b>300 988 374,15</b>	<b>90,150</b>
SCATEC SOLAR ASA	286 451,0000	124,10	NOK	3 603 960,88	1,080
<b>TOTAL devise NOK</b>				<b>3 603 960,88</b>	<b>1,080</b>
<b>TOTAL Actions et titres assimilés</b>				<b>317 598 452,09</b>	<b>95,130</b>

Désignation des valeurs	Quantité	Cours	Devise	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>OPCVM</b>					
LBPAM TRESORERIE-M	1 026,0000	9 906,55	EUR	10 164 120,30	3,050
<b>TOTAL devise EUR</b>				<b>10 164 120,30</b>	<b>3,050</b>
<b>TOTAL OPCVM</b>				<b>10 164 120,30</b>	<b>3,050</b>
<b>Actif net</b>				<b>333 722 288,86</b>	<b>100,00</b>
Federis Pro Actions Isr Euro I dis	13 442,00000	1 109,9000		14 919 354,55	
Federis Pro Actions Isr Euro M dis	228 282,00000	1 396,5300		318 802 934,35	