



La Française Systematic European Equities R



Vertriebszulassung: DE AT

WICHTIGE KENNZAHLEN

Nettoinventarwert : 92.93€

Fondsvermögen : 211,33 Mio.€

SYNTHETISCHE RISIKOINDIKATOR



ANLAGEHORIZONT



MERKMALE

Rechtsform : Investmentfonds-OGAW

Auflagedatum : 04/11/1991

Benchmark : Msci Europe Nr

Ertragsverwendung : Ausschüttung

Währung : EUR

Bewertungshäufigkeit : Täglich

Kundentyp : Alle Kundentypen

Hauptrisiken : Volatilität, Aktien, Währung, Kapitalverlust

FONDSDETAILS

ISIN : DE0009763201

Bloomberg Ticker : VERVALR GR Equity

WKN : 976320

Orderannahmeschluss : T vor 11 Uhr

Settlement Buy/Sell : T+2 werktage

Ausgabeaufschlag max. : 5%

Rücknahmegebühr max. : 0%

Verwaltungsvergütung : 1.50% (31/12/2022)

Laufende Kosten : 1.80% (31/12/2022)

Verwahrstelle : BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland

Bewertungsstelle : BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland

Verwaltungsgesellschaft : La Française Systematic Asset Management GmbH

Fondsmanager : Team La Française Systematic Asset Management GmbH

ANLAGESTRATEGIE

Der Europa-Aktienfonds wählt nach einem systematischen Investmentprozesses unterbewertete europäische Qualitätstitel aus. Dabei werden durch die Faktoren Trendstabilität und Kursrisiko Aktien identifiziert und besser bewertet, die in der Vergangenheit relativ stabile Verläufe zeigten. Ferner misst der Faktor Carbon Impact die CO₂-Intensität eines Unternehmens. Das Investmentvermögen ist nach dem InvStRefG als Aktienfonds klassifiziert.

WERTENTWICKLUNG

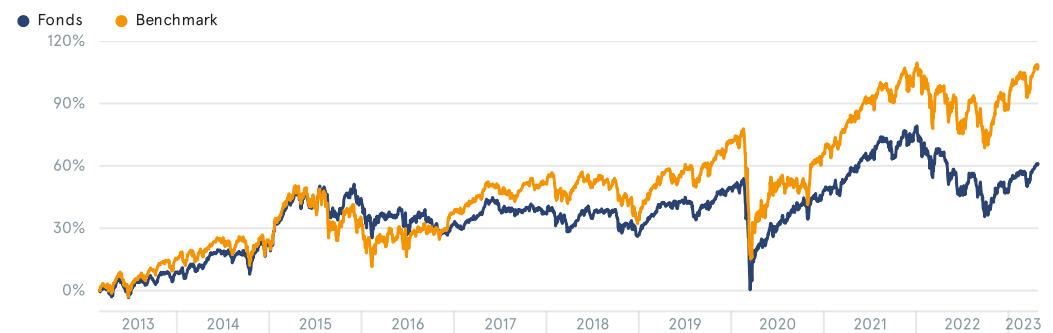
Berechnung nach BVI-Methode. Berechnungsbasis: Anteilwert (Ausgabeaufschläge nicht berücksichtigt), Ausschüttungen wieder angelegt. Anfallende Ausgabeaufschläge reduzieren das eingesetzte Kapital sowie die dargestellte Wertentwicklung. Liegen noch keine Werte über 5 Jahre vor, wird die Wertentwicklung seit Auflage dargestellt.

Kumuliert	1 Monat	3 Monate	1fd. Jahr	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Seit Auflage
Fonds	2.50%	4.07%	9.55%	-0.99%	28.96%	20.47%	319.91%
Benchmark	2.50%	4.24%	11.32%	7.06%	48.37%	37.24%	197.39%
Annualisiert					3 Jahre	5 Jahre	Seit Auflage
Fonds					8.86%	3.80%	4.66%
Benchmark					14.08%	6.54%	3.52%

WERTENTWICKLUNGSHISTORIE

		Jan.	Feb.	Mar.	April	Mai	Juni	Juli	Aug.	Sept.	Okt.	Nov.	Dez.	Jahr
2023	Fonds	5.27%	1.30%	0.22%	2.50%									9.55%
	Benchmark	6.79%	1.77%	-0.08%	2.50%									11.32%
2022	Fonds	-5.58%	-2.51%	1.40%	-2.48%	-3.41%	-6.03%	6.04%	-5.70%	-6.78%	4.69%	4.49%	-2.34%	-17.73%
	Benchmark	-3.37%	-3.01%	0.84%	-0.60%	-0.78%	-7.72%	7.60%	-4.91%	-6.28%	6.22%	6.88%	-3.51%	-9.66%
2021	Fonds	-0.44%	-0.46%	4.99%	2.26%	3.34%	0.41%	3.91%	1.32%	-4.36%	3.36%	0.47%	4.74%	20.90%
	Benchmark	-1.05%	2.54%	6.46%	2.07%	2.56%	1.70%	1.86%	1.97%	-3.01%	4.66%	-2.49%	5.71%	24.97%
2020	Fonds	-0.52%	-9.38%	-11.32%	4.67%	2.82%	0.77%	2.76%	3.92%	2.02%	-4.73%	9.27%	0.72%	-0.96%
	Benchmark	-1.32%	-8.47%	-14.35%	6.12%	2.95%	3.07%	-1.37%	2.94%	-1.41%	-5.01%	13.95%	2.68%	-3.09%
2019	Fonds	5.16%	1.95%	3.94%	0.52%	-1.59%	1.65%	-1.52%	-0.50%	2.40%	1.20%	2.84%	0.73%	17.88%
	Benchmark	6.64%	4.15%	2.03%	3.78%	-4.94%	4.43%	0.30%	-1.44%	3.76%	0.86%	2.69%	2.13%	26.67%

ENTWICKLUNG DER PERFORMANCE SEIT STRATEGIE-WECHSEL (01.03.2013)



FONDSKENNZAHLEN

Wöchentliche Frequenz	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	5 Jahre
Volatilität des Fonds	14.47%	12.95%	15.00%	Max. Gewinn 78.57% (16/03/2020 -> 04/01/2022)
Sharpe ratio	-0.13	0.69	0.26	Max. Verlust -34.83% (20/02/2020 -> 16/03/2020)
Value-at-Risk (99%, 10 Tage)	-6.78%	-7.90%	-9.30%	Recovery 379 Tage (am 30/03/2021)

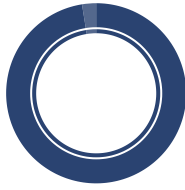
Dieses Dokument ist für professionelle und nicht professionelle Kunden geeignet - ein nicht bindendes Dokument. Bitte beachten Sie vor dem Kauf die Verkaufsunterlagen, die im Internet unter www.la-francaise-systematic-am.com erhältlich sind. Quelle der Daten: La Française, Bloomberg



La Française Systematic European Equities R

ANLAGEKLASSE

in % des Fondsvermögens



■ Aktien	97.47%
■ Kasse	2.53%

ICB-SEKTOREN

In % des Aktienanteils

Finanzgesellschaften	21.37%
Nicht-Basiskonsumgüter	17.98%
Industriewerte	15.43%
Basiskonsumgüter	12.33%
Gesundheit	11.82%
Telekommunikation	7.88%
Technologie	6.80%
Energie	2.26%
Immobilien	2.16%
Versorgungswirtschaft	1.96%

LAND

In % des Aktienanteils

Frankreich	22.76%
Großbritannien	18.85%
Deutschland	11.68%
Niederlande	9.98%
Schweiz	8.88%
Finnland	6.56%
Spanien	5.92%
Irland	4.24%
Schweden	3.62%
Italien	3.17%
Sonstige	4.32%

KAPITALISIERUNGSGRÖSSE

In % des Aktienanteils

Große Kapi (>5 Md€)	100.00%
---------------------	---------

CARBON FOOTPRINT

Finanzierte CO₂-Emissionen tCO₂e/investierter Mio. EUR

	Fonds	Universum*
Carbon footprint Deckungsrate	99.64%	93.60%
Carbon footprint	10.27	91.76

*Universum: Msci Europe Nr

TOP POSITIONEN

Ohne Geldmarkt

Aktien	Land	ICB-Sektoren	Gewichtung
Swiss Prime Site-reg	Schweiz	Immobilien	2.11%
Dcc Plc	Irland	Industriewerte	2.10%
Roche Holding Ag-bon De Joui	Schweiz	Gesundheit	2.06%
Vinci	Frankreich	Industriewerte	2.05%
Axa	Frankreich	Finanzgesellschaften	2.04%
Edenred	Frankreich	Industriewerte	2.04%
Coca-cola European Plc (eur)	Großbritannien	Basiskonsumgüter	2.04%
Experian Plc	Irland	Industriewerte	2.03%
Informa Plc	Großbritannien	Nicht-Basiskonsumgüter	2.03%
Pearson	Großbritannien	Nicht-Basiskonsumgüter	2.02%

Anzahl der Wertpapiere: 100

Top-10 Einzeltitel: 20.51%

KÄUFE/VERKÄUFE DES VERGANGENEN MONATS

Ohne Geldmarkt und in % des Nettoinventarwerts zum Transaktionsdatum

Neue Positionen	%	Saldierte Positionen	%
Keine neue Position		Abb Ltd	-2.02%
Verstärkte Positionen	%	Reduzierte Positionen	%
Amadeus It Group Sa	1.97%	Keine verringerte Position	



La Française Systematic European Equities R

DISCLAIMER

Diese Kundeninformation stellt eine Werbung gemäß § 63 Abs. 6 WpHG dar; Sie ist weder als Kauf- oder Verkaufsangebot noch als eine Anlageberatung zu verstehen. Alle Angaben und Einschätzungen wurden mit größter Sorgfalt zusammengestellt. Für die Richtigkeit kann jedoch keine Gewähr übernommen werden. Bei den dargestellten Wertentwicklungen handelt es sich um Vergangenheitswerte, aus denen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung der Fonds gezogen werden können. Zukünftige Ergebnisse können sowohl höher als auch niedriger ausfallen. Provisionen und Kosten, die bei Ausgabe und Rücknahme von Anteilen entstehen, bleiben bei der Berechnung der Wertentwicklung unberücksichtigt. Alleinverbindliche Grundlage für den Kauf von Fonds sind ausschließlich die aktuellen Verkaufsunterlagen (Verkaufsprospekt, die Wesentlichen Informationen für Anleger, Jahresbericht und - falls dieser älter als acht Monate ist - der Halbjahresbericht). Die Verkaufsunterlagen sind in deutscher Sprache kostenlos erhältlich beim Herausgeber La Française Systematic Asset Management GmbH, Neue Mainzer Straße 80 - 60311 Frankfurt/Main, Telefon +49 (0)69 975743-0 oder online unter www.la-francaise-systematic-am.com sowie bei folgenden Zahlstellen: In Österreich bei der Zahlstelle Société Générale S.A., Paris, Zweigniederlassung Wien, Prinz-Eugen-Straße 8-10/5/TOP 11, A-1040 Wien. Die täglichen Fondspreise finden Sie unter www.la-francaise-systematic-am.com.

SFDR-Klassifizierung : Die Sustainable Finance Disclosure Regulation zielt darauf ab, Kapitalflüsse in verantwortungsvollere Anlagen zu lenken, Transparenz, Konsistenz und Qualität der Informationen für Anleger zu gewährleisten und somit einen Vergleich der verschiedenen Anlagevehikel zu ermöglichen.

Es gilt für alle Finanzmarktakteure aber auch für Produkte.

3 Produktkategorien:

1/ Automatisch werden alle Fonds in Artikel 6 eingeordnet, ohne Nachhaltigkeitsziel.

2/ Danach kommt Artikel 8 für Fonds, die fördern ESG-Eigenschaften.

3/ Artikel 9 geht noch weiter, mit einem nachhaltigen und messbaren Anlageziel. Das heißt, die Fonds investieren in eine Aktivität, die zu einem ökologischen oder sozialen Ziel beiträgt, wie beispielsweise die Reduzierung von CO₂-Emissionen oder die Bekämpfung von Ungleichheit.

DEFINITIONEN

Der synthetische Risikoindikator ermöglicht es, das Risikoniveau dieses Produkts im Vergleich zu anderen zu beurteilen. Er gibt die Wahrscheinlichkeit an, dass dieses Produkt Verluste verzeichnet, wenn es zu Marktbewegungen kommt oder wir nicht in der Lage sind, Sie auszuzahlen.

Sofern beim Erwerb der Fondsanteile ein Ausgabeaufschlag anfällt, kann dieser bis zu 100 % vom Vertriebspartner vereinnahmt werden; die genaue Höhe des Betrages wird durch den Vertriebspartner im Rahmen der Anlageberatung auf Rückfrage mitgeteilt. Letzteres gilt auch für eventuelle Zahlungen einer laufenden Vertriebsprovision durch die Verwaltungsgesellschaft an den Vertriebspartner.

Berechnungsbasis der Wertentwicklung : Anteilwert; Ausschüttungen wieder angelegt. Die Berechnung erfolgt nach der BVI-Methode. Provisionen und Kosten, die bei Ausgabe und Rücknahme von Anteilen entstehen, bleiben bei der Berechnung der Wertentwicklung unberücksichtigt. Bei einem Anlagebetrag von EUR 1.000,00 über eine Anlageperiode von fünf Jahren und falls vorhanden einem Ausgabeaufschlag von z. B. 5 Prozent würde sich das Anlageergebnis im ersten Jahr um den Ausgabeaufschlag in Höhe von EUR 50,00 sowie um zusätzlich individuell anfallende Depotkosten vermindern. In den Folgejahren kann sich das Anlageergebnis zudem um individuell anfallende Depotkosten vermindern. Ausgabeaufschläge und Depotkosten reduzieren das eingesetzte Kapital sowie die dargestellte Wertentwicklung. Angaben zur bisherigen Wertentwicklung erlauben keine Prognose für die Zukunft.

Die Volatilität ist ein Maß für die Schwankungsstärke der Wertentwicklung des Fonds während eines bestimmten Zeitraumes. Je höher diese ist, desto volatil und damit risikoreicher ist ein Fonds.

Die Sharpe-Ratio misst die Überrendite eines Fonds in Abhängigkeit vom Risiko zu einer Benchmark (risikoloser Zinssatz). Zur Ermittlung dieser Kennzahl wird die risikolose erzielbare Rendite von der tatsächlich erzielten Rendite abgezogen. Das Ergebnis wird durch das eingegangene Risiko des Fonds geteilt. Eine Sharpe-Ratio > 1 zeigt an, dass gegenüber der risikolosen Geldmarktanlage eine Mehrrendite erwirtschaftet wurde. Zum anderen zeigt sie an, in welchem Verhältnis diese Überrendite zum eingegangenen Risiko steht. Umgekehrt verdeutlicht eine negative Sharpe-Ratio (<0), dass die Geldmarktzinsung nicht übertroffen wurde.

Bei der Value-at-Risk-Methode handelt es sich um den maximalen potenziellen Verlust eines Anlegers im Wert eines Vermögenswerts oder eines Portfolios finanzieller Vermögenswerte, der nur mit einer bestimmten Wahrscheinlichkeit über einen bestimmten Zeithorizont zu erzielen ist.

Recovery gibt die Zeit, an die benötigt wird, um den maximalen Verlust (max. Drawdown) wieder einzuholen.