



LA FRANÇAISE
SYSTEMATIC ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht La Française Systematic European Equities

vom 01.01.2024 bis 30.06.2024

La Française Systematic Asset Management GmbH

La Française Systematic Asset Management GmbH
Neue Mainzer Str. 80
60311 Frankfurt am Main

Handelsregister:
Frankfurt HRB 34125

Geschäftsführung:
Berit Jauch
Dennis Jeske
Kay Scherf
Mark Wolter

www.la-francaise-systematic-am.com

La Française Systematic European Equities

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024

| | Kurswert in EUR | Kurswert in EUR | % des Fondsver- mögens |
|-----------------------------------|--------------------|-----------------------|------------------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | 214.187.951,50 | 100,15 |
| 1. Aktien | | 208.215.508,95 | 97,35 |
| - Aeronautik und Weltraum | 1.428.829,80 | | 0,67 |
| - Audiovisuelle Industrie | 1.694.322,16 | | 0,79 |
| - Banken | 26.830.617,43 | | 12,55 |
| - Bau und Baustoffe | 13.414.062,79 | | 6,27 |
| - Büroausstattung | 3.618.178,80 | | 1,69 |
| - Chemische Industrie | 3.431.068,16 | | 1,60 |
| - Einzelhandel | 9.362.347,36 | | 4,38 |
| - Elektrik / Elektronik | 5.861.429,70 | | 2,74 |
| - Energieversorger | 5.862.332,65 | | 2,74 |
| - Holdinggesellschaften | 805.560,95 | | 0,38 |
| - Maschinenbau und Fahrzeugbau | 18.858.675,49 | | 8,82 |
| - Pharmaindustrie / Biotech | 33.415.121,34 | | 15,62 |
| - Real Estate | 4.318.117,74 | | 2,02 |
| - Software | 3.736.641,99 | | 1,75 |
| - Sonstige Dienstleistungen | 10.723.120,43 | | 5,01 |
| - Sonstige Finanzdienstleistungen | 5.072.956,70 | | 2,37 |
| - Sonstige industrielle Werte | 4.307.527,18 | | 2,01 |
| - Telekommunikation | 14.906.119,36 | | 6,97 |
| - Transportation | 846.257,88 | | 0,40 |
| - Unterhaltungsindustrie | 1.522.481,84 | | 0,71 |
| - Verbrauchsgüter | 19.935.881,95 | | 9,32 |
| - Versicherungen | 18.263.857,25 | | 8,54 |
| 2. Investmentanteile | | 4.233.038,63 | 1,98 |
| - Frankreich | 4.233.038,63 | | 1,98 |
| 3. Forderungen | | 1.621.519,15 | 0,76 |
| 4. Bankguthaben | | 117.884,77 | 0,06 |
| II. Verbindlichkeiten | | -313.256,70 | -0,15 |
| III. Fondsvermögen | | 213.874.694,80 | 100,00 ¹⁾ |

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

La Française Systematic European Equities

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Markt | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Bestand 30.06.2024 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Kurs | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens | |
|-------------------------------------|---------------------------------|-------|---------------------------------------|--------------------|----------------|-------------------|---------------------|----------------------|----------------------|------|
| | | | | | | | im Berichtszeitraum | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | | | | |
| Aktien | | | | | | | | | | |
| Inland | | | | | | | | | | |
| DE0008404005 | Allianz SE | STK | | 3.091 | 0 | 363 | EUR | 259,500 | 802.114,50 | 0,38 |
| DE0005190003 | Bayerische Motoren Werke AG | STK | | 7.195 | 0 | 812 | EUR | 88,380 | 635.894,10 | 0,30 |
| DE0005200000 | Beiersdorf AG | STK | | 31.921 | 2.677 | 589 | EUR | 136,550 | 4.358.812,55 | 2,04 |
| DE000A1DAHH0 | Brenntag SE | STK | | 54.496 | 43.917 | 0 | EUR | 62,960 | 3.431.068,16 | 1,60 |
| DE000CBK1001 | Commerzbank AG | STK | | 61.439 | 68.197 | 6.758 | EUR | 14,185 | 871.512,22 | 0,41 |
| DE0005140008 | Deutsche Bank AG | STK | | 55.757 | 55.757 | 0 | EUR | 14,908 | 831.225,36 | 0,39 |
| DE0005810055 | Deutsche Börse AG | STK | | 4.406 | 4.406 | 0 | EUR | 191,100 | 841.986,60 | 0,39 |
| DE0005557508 | Deutsche Telekom AG | STK | | 186.557 | 147.802 | 0 | EUR | 23,480 | 4.380.358,36 | 2,05 |
| DE0006602006 | GEA Group AG | STK | | 107.807 | 0 | 3.697 | EUR | 38,900 | 4.193.692,30 | 1,96 |
| DE0008402215 | Hannover Rück SE | STK | | 3.516 | 0 | 13.897 | EUR | 236,700 | 832.237,20 | 0,39 |
| DE0007100000 | Mercedes-Benz Group AG | STK | | 10.792 | 0 | 47.777 | EUR | 64,570 | 696.839,44 | 0,33 |
| DE0008430026 | Münchener Rückvers.-Ges. AG | STK | | 1.961 | 56 | 168 | EUR | 467,000 | 915.787,00 | 0,43 |
| DE0007236101 | Siemens AG | STK | | 9.830 | 0 | 18.793 | EUR | 173,720 | 1.707.667,60 | 0,80 |
| | | | | | | | EUR | 24.499.195,39 | 11,45 | |
| Ausland | | | | | | | | | | |
| GB00B1YW4409 | 3i Group PLC | STK | | 25.190 | 0 | 7.784 | GBP | 30,660 | 910.922,22 | 0,43 |
| CH0012221716 | ABB Ltd. | STK | | 95.951 | 102.738 | 6.787 | CHF | 49,920 | 4.973.650,30 | 2,33 |
| ES0167050915 | ACS, Act.de Constr.y Serv. SA | STK | | 109.370 | 86.636 | 0 | EUR | 40,280 | 4.405.423,60 | 2,06 |
| ES0105046009 | Aena SME S.A. | STK | | 4.625 | 4.873 | 248 | EUR | 188,000 | 869.500,00 | 0,41 |
| BE0974264930 | AGEAS SA/NV | STK | | 19.087 | 0 | 1.394 | EUR | 42,680 | 814.633,16 | 0,38 |
| NL0011794037 | Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. | STK | | 150.844 | 123.916 | 0 | EUR | 27,590 | 4.161.785,96 | 1,95 |
| IE00BF0L3536 | AlB Group PLC | STK | | 288.507 | 288.507 | 0 | EUR | 4,936 | 1.424.070,55 | 0,67 |
| NL0000235190 | Airbus SE | STK | | 4.950 | 27.938 | 22.988 | EUR | 128,260 | 634.887,00 | 0,30 |
| SE0000695876 | Alfa Laval AB | STK | | 63.582 | 63.582 | 0 | SEK | 464,100 | 2.599.859,58 | 1,22 |
| ES0109067019 | Amadeus IT Group S.A. | STK | | 71.870 | 9.312 | 4.149 | EUR | 62,140 | 4.466.001,80 | 2,09 |
| IT0000062072 | Assicurazioni Generali S.p.A. | STK | | 36.007 | 0 | 4.038 | EUR | 23,290 | 838.603,03 | 0,39 |
| SE0017486889 | Atlas Copco AB | STK | | 258.115 | 258.115 | 0 | SEK | 199,200 | 4.530.088,81 | 2,12 |
| GB00BVYVFW23 | Auto Trader Group PLC | STK | | 405.579 | 308.509 | 56.961 | GBP | 8,012 | 3.832.634,25 | 1,79 |
| FR0000120628 | AXA S.A. | STK | | 24.085 | 0 | 3.765 | EUR | 30,570 | 736.278,45 | 0,34 |
| ES0113211835 | Banco Bilbao Vizcaya Argent. | STK | | 77.755 | 0 | 20.597 | EUR | 9,352 | 727.164,76 | 0,34 |
| IT0005218380 | Banco BPM S.p.A. | STK | | 132.043 | 132.043 | 0 | EUR | 6,014 | 794.106,60 | 0,37 |
| ES0113900J37 | Banco Santander S.A. | STK | | 178.555 | 815.824 | 851.182 | EUR | 4,331 | 773.232,43 | 0,36 |
| CH0531751755 | Banque Cantonale Vaudoise | STK | | 8.024 | 8.024 | 0 | CHF | 95,350 | 794.443,07 | 0,37 |
| GB00BLJXL82 | Berkeley Group Holdings PLC | STK | | 33.200 | 54.712 | 38.119 | GBP | 45,880 | 1.796.563,07 | 0,84 |
| FR0000131104 | BNP Paribas S.A. | STK | | 12.287 | 0 | 646 | EUR | 59,530 | 731.445,11 | 0,34 |
| GB00B0744B38 | Bunzl PLC | STK | | 120.166 | 97.626 | 0 | GBP | 30,100 | 4.266.080,79 | 1,99 |
| FR0006174348 | Bureau Veritas SA | STK | | 30.391 | 1.637 | 4.421 | EUR | 25,860 | 785.911,26 | 0,37 |
| ES0140609019 | Caixabank S.A. | STK | | 173.921 | 138.825 | 169.219 | EUR | 4,943 | 859.691,50 | 0,40 |
| FR0000125338 | Capgemini SE | STK | | 19.484 | 0 | 2.661 | EUR | 185,700 | 3.618.178,80 | 1,69 |
| FR0000120172 | Carrefour S.A. | STK | | 51.561 | 0 | 169.362 | EUR | 13,200 | 680.605,20 | 0,32 |
| GB00B033F229 | Centrica PLC | STK | | 1.759.391 | 1.320.060 | 0 | GBP | 1,349 | 2.799.337,69 | 1,31 |
| CH0010570767 | Chocoladef. Lindt & Sprüngli | STK | | 391 | 391 | 0 | CHF | 10.490,000 | 4.258.958,52 | 1,99 |
| FR001400AJ45 | Cie Génie Étis Michelin SCpA | STK | | 116.315 | 126.184 | 9.869 | EUR | 36,110 | 4.200.134,65 | 1,96 |
| GB00BDCPN049 | Coca-Cola Europacific Pa. PLC | STK | | 49.026 | 21.135 | 17.913 | EUR | 68,400 | 3.353.378,40 | 1,57 |
| FR0000045072 | Crédit Agricole S.A. | STK | | 58.248 | 60.059 | 1.811 | EUR | 12,740 | 742.079,52 | 0,35 |
| FR0000120644 | Danone S.A. | STK | | 14.289 | 14.289 | 0 | EUR | 57,080 | 815.616,12 | 0,38 |
| DK0010274414 | Danske Bank AS | STK | | 29.584 | 0 | 135.922 | DKK | 207,500 | 823.160,73 | 0,38 |
| NO0010161896 | DNB Bank ASA | STK | | 44.099 | 74.689 | 71.668 | NOK | 209,700 | 810.372,02 | 0,38 |
| FR0000130452 | Eiffage S.A. | STK | | 41.128 | 32.978 | 994 | EUR | 85,760 | 3.527.137,28 | 1,65 |
| FI0000907884 | Elisa Oyj | STK | | 19.549 | 1.893 | 0 | EUR | 42,840 | 837.479,16 | 0,39 |
| FR0010208488 | Engie S.A. | STK | | 52.364 | 52.364 | 0 | EUR | 13,335 | 698.273,94 | 0,33 |
| IT0003132476 | ENI S.p.A. | STK | | 164.743 | 164.743 | 0 | EUR | 14,354 | 2.364.721,02 | 1,11 |
| AT0000652011 | Erste Group Bank AG | STK | | 19.293 | 0 | 4.236 | EUR | 44,240 | 853.522,32 | 0,40 |
| FR0000121667 | EssilorLuxottica S.A. | STK | | 20.330 | 20.330 | 0 | EUR | 201,200 | 4.090.396,00 | 1,91 |
| FR0000121121 | Eurazeo SE | STK | | 10.069 | 10.069 | 70.153 | EUR | 74,350 | 748.630,15 | 0,35 |
| NL0011585146 | Ferrari N.V. | STK | | 2.139 | 0 | 565 | EUR | 380,700 | 814.317,30 | 0,38 |
| GB00BN7SWP63 | GSK PLC | STK | | 219.216 | 229.717 | 10.501 | GBP | 15,295 | 3.954.601,31 | 1,85 |
| GB0005405286 | HSBC Holdings PLC | STK | | 108.016 | 5.878 | 0 | GBP | 6,839 | 871.287,87 | 0,41 |
| SE0000107203 | Industrivärden AB | STK | | 25.568 | 0 | 5.406 | SEK | 357,600 | 805.560,95 | 0,38 |
| GB00BMJ6DW54 | Informa PLC | STK | | 86.552 | 0 | 3.820 | GBP | 8,558 | 873.635,69 | 0,41 |
| NL0011821202 | ING Groep N.V. | STK | | 52.330 | 0 | 9.226 | EUR | 15,962 | 835.291,46 | 0,39 |
| IT0000072618 | Intesa Sanpaolo S.p.A. | STK | | 249.006 | 0 | 69.713 | EUR | 3,471 | 864.299,83 | 0,40 |
| FR0010259150 | Ipsen S.A. | STK | | 37.635 | 31.402 | 0 | EUR | 114,500 | 4.309.207,50 | 2,01 |
| PTJMT0AE0001 | Jerónimo Martins, SGPS, S.A. | STK | | 119.375 | 119.375 | 0 | EUR | 18,250 | 2.178.593,75 | 1,02 |
| BE0003565737 | KBC Groep N.V. | STK | | 11.852 | 0 | 1.396 | EUR | 65,900 | 811.046,80 | 0,37 |
| FR0000121964 | Klépierre S.A. | STK | | 172.863 | 172.863 | 0 | EUR | 24,980 | 4.318.117,74 | 2,02 |
| NL0000009082 | Kon. KPN N.V. | STK | | 1.203.581 | 957.556 | 0 | EUR | 3,580 | 4.308.819,98 | 2,01 |
| FR0013451333 | LA FRANCAISE DES JEUX | STK | | 22.288 | 0 | 104.034 | EUR | 31,800 | 708.758,40 | 0,33 |
| GB0008706128 | Lloyds Banking Group PLC | STK | | 1.316.852 | 0 | 243.654 | GBP | 0,547 | 850.203,20 | 0,40 |
| GB00B0SWJX34 | London Stock Exchange Group PLC | STK | | 38.162 | 30.065 | 0 | GBP | 94,000 | 4.230.970,10 | 1,98 |
| FR0000120321 | L'Oréal S.A. | STK | | 1.994 | 133 | 79 | EUR | 410,050 | 817.639,70 | 0,38 |
| GB00BKFB1C65 | M&G PLC | STK | | 1.699.092 | 1.699.092 | 0 | GBP | 2,040 | 4.088.161,44 | 1,91 |
| IT0000062957 | Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA | STK | | 134.085 | 72.209 | 0 | EUR | 13,690 | 1.835.623,65 | 0,86 |
| GB0032089863 | NEXT PLC | STK | | 40.302 | 5.199 | 209 | GBP | 90,360 | 4.295.204,01 | 2,01 |

| | | | | | | | | | |
|------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|-----|-------------|---------|---------|------------|-------------|-----------------------|-----------------------------|
| FI4000297767 | Nordea Bank Abp | STK | 291.381 | 291.381 | 0 | EUR | 11,115 | 3.238.699,82 | 1,51 |
| FI4000297767 | Nordea Bank Abp | STK | 70.468 | 0 | 4.374 | SEK | 126,100 | 782.908,79 | 0,37 |
| DK0062498333 | Novo-Nordisk AS | STK | 17.710 | 0 | 27.614 | DKK | 1.005,600 | 2.388.105,32 | 1,12 |
| FR0000133308 | Orange S.A. | STK | 77.939 | 201.153 | 223.999 | EUR | 9,354 | 729.041,41 | 0,34 |
| DK0060252690 | Pandora A/S | STK | 5.684 | 14.477 | 24.923 | DKK | 1.051,000 | 801.062,56 | 0,37 |
| GB0006776081 | Pearson PLC | STK | 70.228 | 70.228 | 0 | GBP | 9,908 | 820.686,47 | 0,38 |
| IT0003796171 | Poste Italiane S.p.A. | STK | 71.144 | 0 | 298.537 | EUR | 11,895 | 846.257,88 | 0,40 |
| FR0000130577 | Publicis Groupe S.A. | STK | 8.188 | 0 | 43.404 | EUR | 99,380 | 813.723,44 | 0,38 |
| IT0003828271 | Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA | STK | 83.220 | 83.220 | 0 | EUR | 48,700 | 4.052.814,00 | 1,89 |
| GB00B2B0DG97 | Relx PLC | STK | 21.383 | 0 | 2.493 | GBP | 36,390 | 917.765,37 | 0,43 |
| FR0000073272 | SAFRAN | STK | 4.022 | 15.470 | 11.448 | EUR | 197,400 | 793.942,80 | 0,37 |
| GB00B8C3BL03 | Sage Group PLC, The | STK | 291.053 | 0 | 47.589 | GBP | 10,885 | 3.736.641,99 | 1,75 |
| FI4000552500 | Sampo OYJ | STK | 103.207 | 103.207 | 0 | EUR | 40,100 | 4.138.600,70 | 1,94 |
| FR0000121972 | Schneider Electric SE | STK | 3.958 | 3.958 | 0 | EUR | 224,300 | 887.779,40 | 0,42 |
| SE0000148884 | Skandinaviska Enskilda Banken | STK | 63.611 | 0 | 5.702 | SEK | 156,500 | 877.103,22 | 0,41 |
| FR0000121220 | Sodexo S.A. | STK | 53.416 | 45.610 | 267 | EUR | 84,000 | 4.486.944,00 | 2,10 |
| NL00150001Q9 | Stellantis N.V. | STK | 163.210 | 189.766 | 26.556 | EUR | 18,470 | 3.014.488,70 | 1,41 |
| SE0007100599 | Svenska Handelsbanken AB | STK | 85.695 | 85.695 | 0 | SEK | 100,950 | 762.194,74 | 0,36 |
| SE0000242455 | Swedbank AB | STK | 42.966 | 0 | 2.249 | SEK | 218,100 | 825.628,60 | 0,39 |
| CH0126881561 | Swiss Re AG | STK | 7.513 | 13.036 | 31.241 | CHF | 111,500 | 869.840,09 | 0,41 |
| CH0008742519 | Swisscom AG | STK | 1.558 | 199 | 0 | CHF | 505,500 | 817.786,20 | 0,38 |
| CH0244767585 | UBS Group AG | STK | 28.867 | 145.542 | 116.675 | CHF | 26,450 | 792.827,11 | 0,37 |
| IT0005239360 | UniCredit S.p.A. | STK | 23.636 | 31.306 | 7.670 | EUR | 34,605 | 817.923,78 | 0,38 |
| GB00B10RZP78 | Unilever PLC | STK | 92.469 | 76.098 | 0 | GBP | 43,450 | 4.738.784,04 | 2,22 |
| FR0000125486 | VINCI S.A. | STK | 28.618 | 2.805 | 9.454 | EUR | 98,380 | 2.815.438,84 | 1,32 |
| SE0000115446 | Volvo (publ), AB | STK | 32.372 | 0 | 164.409 | SEK | 271,100 | 773.220,19 | 0,36 |
| NL0000395903 | Wolters Kluwer N.V. | STK | 29.415 | 22.788 | 0 | EUR | 154,800 | 4.553.442,00 | 2,13 |
| CH0011075394 | Zurich Insurance Group AG | STK | 8.498 | 8.498 | 8.130 | CHF | 479,100 | 4.227.601,68 | 1,98 |
| | | | | | | EUR | | 179.011.552,64 | 83,70 |
| Andere Wertpapiere | | | | | | | | | |
| Ausland | | | | | | | | | |
| CH0012032048 | Roche Holding AG - Genussscheine | STK | 18.160 | 3.441 | 164 | CHF | 249,500 | 4.704.760,92 | 2,20 |
| | | | | | | EUR | | 4.704.760,92 | 2,20 |
| Investmentanteile | | | | | | | | | |
| Gruppeneigene Investmentanteile | | | | | | | | | |
| FR0010609115 | LA FRANCAISE - LF Trésorerie | ANT | 38 | 86 | 48 | EUR | 112.881,030 | 4.233.038,63 | 1,98 |
| | | | | | | EUR | | 4.233.038,63 | 1,98 |
| | | | | | | EUR | | 212.448.547,58 | 99,33 |
| Summe Wertpapiervermögen | | | | | | | | | |
| Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds | | | | | | | | | |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | EUR | 93.609,69 | | | % | 100,000 | 93.609,69 | 0,04 |
| Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | DKK | 21.848,15 | | | % | 100,000 | 2.929,71 | 0,00 |
| Verwahrstelle | | NOK | 112.805,62 | | | % | 100,000 | 9.885,26 | 0,00 |
| Verwahrstelle | | SEK | 31.530,11 | | | % | 100,000 | 2.777,98 | 0,00 |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | | | | | |
| Verwahrstelle | | CHF | 462,82 | | | % | 100,000 | 480,58 | 0,00 |
| Verwahrstelle | | GBP | 561,34 | | | % | 100,000 | 662,07 | 0,00 |
| Verwahrstelle | | USD | 8.080,44 | | | % | 100,000 | 7.539,48 | 0,00 |
| | | | | | | EUR | | 1.621.519,15 | 0,76 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | | | | | |
| Dividendenforderungen Aktien | | EUR | 0,14 | | | | | 0,14 | 0,00 |
| Dividendenforderungen Aktien | | GBP | 170.267,20 | | | | | 200.822,32 | 0,09 |
| Forderungen aus Anteilzeichnungen | | EUR | 31.679,38 | | | | | 31.679,38 | 0,01 |
| Quellensteuererstattungsansprüche | | CHF | 617.468,48 | | | | | 641.159,32 | 0,30 |
| Quellensteuererstattungsansprüche | | DKK | 696.874,02 | | | | | 93.446,69 | 0,04 |
| Quellensteuererstattungsansprüche | | EUR | 579.854,75 | | | | | 579.854,75 | 0,27 |
| Quellensteuererstattungsansprüche | | GBP | 51.153,32 | | | | | 60.332,98 | 0,03 |
| Quellensteuererstattungsansprüche | | SEK | 161.437,50 | | | | | 14.223,57 | 0,01 |
| | | | | | | EUR | | -313.256,70 | -0,15 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | | | | |
| Verbindlichkeiten Anleihen | | EUR | -14.136,45 | | | | | -14.136,45 | -0,01 |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse I) | | EUR | -20,60 | | | | | -20,60 | 0,00 |
| Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse R) | | EUR | -299.099,65 | | | | | -299.099,65 | -0,14 |
| | | | | | | EUR | | 213.874.694,80 | 100,00 ²⁾ |
| Fondsvermögen | | | | | | | | | |
| Zurechnung auf Anteilscheinklassen: | | | | | | | | | |
| La Française Systematic European Equities I | | | | | | | | | |
| Anteiliges Fondsvermögen | | | | | | | | | |
| Anteilwert | | | | | | EUR | | 25.302,56 | |
| Umlaufende Anteile | | | | | | EUR | | 1.686,84 | |
| | | | | | | STK | | 15 | |
| La Française Systematic European Equities R | | | | | | | | | |
| Anteiliges Fondsvermögen | | | | | | | | | |
| | | | | | | EUR | | 213.849.392,24 | |

| | | | | | |
|---------------------------|--|--|--|------------|------------------|
| Anteilwert | | | | EUR | 101,61 |
| Umlaufende Anteile | | | | STK | 2.104.617 |

Fußnoten:

2) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte: Kurse per 28.06.2024

Devisenkurse (in Mengennotiz)

| | | | |
|-------------------------|-----|---------|----------------|
| Britische Pfund | GBP | 0,84785 | = 1 Euro (EUR) |
| Dänische Krone | DKK | 7,45745 | = 1 Euro (EUR) |
| Norwegische Krone | NOK | 11,4115 | = 1 Euro (EUR) |
| Schwedische Krone (SEK) | SEK | 11,35 | = 1 Euro (EUR) |
| Schweizer Franken (CHF) | CHF | 0,96305 | = 1 Euro (EUR) |
| US-Dollar (USD) | USD | 1,07175 | = 1 Euro (EUR) |

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzurordnung zum Berichtsstichtag):

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000 | Käufe/ Zugänge | Verkäufe/ Abgänge | Volumen in 1.000 |
|-------------------------------------|------------------------------------------|---------------------------------------|----------------|-------------------|------------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | |
| Aktien | | | | | |
| Inland | | | | | |
| DE000ENAG999 | E.ON SE | STK | 0 | 71.843 | |
| Ausland | | | | | |
| NL0011540547 | ABN AMRO Bank N.V. | STK | 59.249 | 59.249 | |
| ES0167050253 | ACS, Act.de Constr.y Serv. SA | STK | 0 | 0 | |
| ES0667050908 | ACS, Act.de Constr.y Serv. SA - Anrechte | STK | 0 | 0 | |
| NL0000334118 | ASM International N.V. | STK | 0 | 9.705 | |
| NL0010273215 | ASML Holding N.V. | STK | 0 | 6.949 | |
| GB0009895292 | AstraZeneca PLC | STK | 0 | 30.207 | |
| FR000120503 | Bouygues S.A. | STK | 22.533 | 22.533 | |
| GB0007980591 | BP PLC | STK | 149.097 | 149.097 | |
| GB0031743007 | Burberry Group PLC | STK | 0 | 36.089 | |
| CH0210483332 | Cie Financière Richemont AG | STK | 0 | 33.300 | |
| GB0002374006 | Diageo PLC | STK | 0 | 102.672 | |
| BE0974259880 | D'leteren Group S.A. | STK | 0 | 24.610 | |
| DK0060079531 | DSV Panalpina A/S | STK | 0 | 21.882 | |
| FR0010908533 | Edenred S.A. | STK | 0 | 72.757 | |
| SE0015658109 | Epiroc AB | STK | 0 | 42.503 | |
| FR001400OP17 | EssilorLuxottica S.A. - Anrechte | STK | 20.330 | 20.330 | |
| GB00BMX86B70 | Haleon PLC | STK | 0 | 966.241 | |
| CH0102484968 | Julius Baer Gruppe AG | STK | 0 | 12.883 | |
| FR0000121485 | Kering S.A. | STK | 0 | 1.803 | |
| FI0009000202 | Kesko Oyj | STK | 0 | 46.285 | |
| FR0010307819 | Legrand S.A. | STK | 178 | 8.900 | |
| FR0000121014 | LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE | STK | 0 | 1.078 | |
| FI4000552526 | Mandatum OYJ | STK | 0 | 19.690 | |
| IT0004965148 | Moncler S.p.A. | STK | 0 | 31.519 | |
| GB00BM8PJY71 | NatWest Group PLC | STK | 18.359 | 311.116 | |
| CH0012005267 | Novartis AG | STK | 873 | 40.753 | |
| FR0000120693 | Pernod-Ricard S.A. | STK | 0 | 23.929 | |
| NL0015001W49 | Pluxee | STK | 7.806 | 7.806 | |
| NL0012169213 | Qiagen N.V. | STK | 0 | 100.937 | |
| NL0000379121 | Randstad N.V. | STK | 0 | 73.290 | |
| GB00B24CGK77 | Reckitt Benckiser Group | STK | 896 | 12.325 | |
| ES0173516115 | Repsol S.A. | STK | 51.591 | 304.825 | |
| GB00B019KW72 | Sainsbury PLC, J. | STK | 0 | 1.234.983 | |
| CH1243598427 | Sandoz Group AG | STK | 0 | 8.749 | |
| FR0000120578 | Sanofi S.A. | STK | 0 | 37.439 | |
| GB00BP6MXD84 | Shell PLC | STK | 40.857 | 40.857 | |
| GB00BR1W9C86 | Shell PLC - Anrechte | STK | 40.857 | 40.857 | |
| CH0014852781 | Swiss Life Holding AG | STK | 0 | 1.303 | |
| GB00BLGZ9862 | Tesco PLC | STK | 882.355 | 1.136.235 | |
| FR0000121329 | THALES S.A. | STK | 5.795 | 5.795 | |
| FR0000120271 | TotalEnergies SE | STK | 13.253 | 13.253 | |
| NL00150001Y2 | Universal Music Group N.V. | STK | 0 | 30.812 | |
| AT0000746409 | Verbund AG | STK | 9.310 | 9.310 | |
| NL0015001Z20 | Wolters Kluwer N.V. - Anrechte | STK | 29.415 | 29.415 | |
| JE00B8KF9B49 | WPP PLC | STK | 0 | 91.961 | |

La Française Systematic European Equities

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

Sonstige Angaben

La Française Systematic European Equities I

International Security Identification Number (ISIN)

DE000A0MKQJ9

| | | |
|-----------------------------|-----|-------------------------|
| Anteilwert | EUR | 1.686,84 |
| Umlaufende Anteile | STK | 15 |
| Auflagedatum | | 07.02.2014 |
| Mindestanlagesumme | EUR | 100.000 |
| Anleger | | Institutionelle Anleger |
| Aktueller Ausgabeaufschlag | % | 0,00 |
| Aktueller Rücknahmeabschlag | % | 0,00 |
| Verwaltungsvergütung p. a. | % | 0,75 |
| Ertragsverwendung | | thesaurierend |

La Française Systematic European Equities R

International Security Identification Number (ISIN)

DE0009763201

| | | |
|-----------------------------|-----|-----------------|
| Anteilwert | EUR | 101,61 |
| Umlaufende Anteile | STK | 2.104.617,33 |
| Auflagedatum | | 04.11.1991 |
| Mindestanlagesumme | EUR | keine |
| Anleger | | Private Anleger |
| Aktueller Ausgabeaufschlag | % | 5,00 |
| Aktueller Rücknahmeabschlag | % | 0,00 |
| Verwaltungsvergütung p. a. | % | 1,50 |
| Ertragsverwendung | | ausschüttend |

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

99,33

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

0,00

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2024 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2024 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

| | |
|----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände | zum Nennwert |
| Verbindlichkeiten | zum Rückzahlungsbetrag |
| Fremdwährungsumrechnung | auf Basis der Closing Spot-Kurse von WM Company / Reuters |

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Frankfurt am Main, den 5. August 2024

La Française Systematic Asset Management GmbH

Die Geschäftsführung

ANGABEN ZUR GESELLSCHAFT

La Française Systematic Asset Management GmbH

Neue Mainzer Str. 80
60311 Frankfurt am Main
Tel.: +49 (0) 69 97 57 43 -0
Fax: +49 (0) 69 97 57 43 -81
info-am@la-francaise.com
www.la-francaise-systematic-am.com

Haftendes Eigenkapital
€ 6,2 Mio., Stand 31.12.2023
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
€ 2,6 Mio., Stand 31.12.2023

Gesellschafter

Groupe La Française
Paris

Geschäftsführer

Berit Jauch,
20355 Hamburg

Dennis Jeske,
63128 Dietzenbach

Kay Scherf,
63110 Rodgau

Mark Wolter,
53925 Kall

Verwahrstelle

BNP Paribas S.A.
Niederlassung Deutschland
Senckenberganlage 19
60325 Frankfurt am Main
Haftendes Eigenkapital: € 121.74 Mio.
Stand 31.12.2023

Wirtschaftsprüfer

FFA Frankfurt Finance Audit GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Philippe Lecomte
CEO La Française AM Finance Services
Head Business & Corporate Development
Groupe La Française
Paris
Vorsitzender

Philippe Verdier
Chief Financial Officer
Group La Française,
Paris
Stellvertretender Vorsitzender

Dr. Sybille Hofmann
unabhängige Aufsichtsrätin

Verbandsmitglied bei

BVI Bundesverband
Investment und Asset Management e.V.
Frankfurt am Main



LA FRANÇAISE

SYSTEMATIC ASSET MANAGEMENT

La Française Systematic Asset Management GmbH

Neue Mainzer Str. 80

60311 Frankfurt am Main

Tel.: +49 (0) 69 97 57 43 -0

Fax: +49 (0) 69 97 57 43 -81

info-am@la-francaise.com

www.la-francaise-systematic-am.com