



La Française Systematic European Equities I



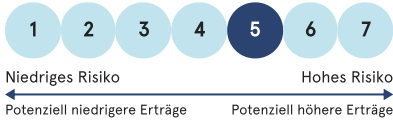
Vertriebszulassung: DE AT

WICHTIGE KENNZAHLEN

Nettoinventarwert : 1.522.37€

Fondsvermögen : 222,00Mio.€

RISIKO-RENDITE-PROFIL



ANLAGEHORIZONT



MERKMALE

Rechtsform : Investmentfonds-OGAW

Auflegedatum : 07/02/2014

Benchmark : Msci Europe Nr

Ertragsverwendung : Thesaurierend

Währung : EUR

Bewertungshäufigkeit : Täglich

Kundentyp : Institutionell

Hauptrisiken : Volatilität, Aktien, Währung, Kapitalverlust

FONDSDETAILS

ISIN : DE000AOMKQJ9

Bloomberg Ticker : VERVALI GR Equity

WKN : AOMKQJ

Orderannahmeschluss : T vor 11 Uhr

Settlement Buy/Sell : T+2 werktage

Mindestanlagesumme : 100,000 EUR

Ausgabeaufschlag max. : 0%

Rücknahmegebühr max. : 0%

Verwaltungsvergütung : 0.75% (31/12/2021)

Laufende Kosten : 1.02% (31/12/2021)

Verwahrstelle : BNP Paribas Securities Services S.C.A., Zweigniederlassung Frankfurt am Main

Bewertungsstelle : BNP Paribas Securities Services S.C.A., Zweigniederlassung Frankfurt am Main

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	lfd. Jahr	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Seit Auflage
Fonds	-2.43%	-3.43%	-8.76%	4.21%	16.92%	20.31%	60.10%
Benchmark	-0.60%	-2.78%	-6.06%	6.48%	22.55%	31.31%	69.57%

Annualisiert	3 Jahre	5 Jahre	Seit Auflage
Fonds	5.35%	3.76%	5.89%
Benchmark	7.01%	5.59%	6.63%

WERTENTWICKLUNGSHISTORIE

		Jan.	Feb.	Mar.	April	Mai	Juni	Juli	Aug.	Sept.	Okt.	Nov.	Dez.	Jahr
2022	Fonds	-5.52%	-2.45%	1.46%	-2.43%									-8.76%
	Benchmark	-3.37%	-3.01%	0.84%	-0.60%									-6.06%
2021	Fonds	-0.38%	-0.40%	5.01%	2.32%	3.40%	0.48%	3.97%	1.38%	-4.30%	3.42%	0.55%	4.80%	21.76%
	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	-0.46%	-9.33%	-11.48%	4.72%	2.87%	0.85%	2.83%	3.98%	2.08%	-4.66%	9.34%	0.78%	-0.47%
	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	5.23%	2.02%	3.98%	0.59%	-1.53%	1.71%	-1.46%	-0.43%	2.47%	1.26%	2.89%	0.80%	18.74%
	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%
2018	Fonds	0.07%	-1.36%	-3.95%	2.71%	2.14%	-0.71%	2.01%	0.55%	0.29%	-5.87%	0.93%	-3.96%	-7.31%
	Benchmark	1.60%	-3.87%	-2.02%	4.61%	0.74%	-1.32%	3.11%	-2.24%	0.53%	-5.31%	-0.86%	-5.92%	-10.94%

WERTENTWICKLUNG SEIT AUFLAGE



FONDSKENNZAHLEN

Wöchentliche Frequenz	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	5 Jahre
Volatilität des Fonds	11.61%	16.45%	14.22%	Max. Gewinn 80.45% (16/03/2020 -> 04/01/2022)
Sharpe ratio	0.33	0.36	0.31	Max. Verlust -34.79% (20/02/2020 -> 16/03/2020)
Value-at-Risk (99%, 10 Tage)	-8.89%	-11.75%	-9.42%	Recovery 365 Tage (am 16/03/2021)

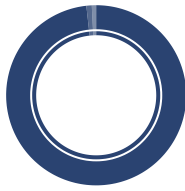
Dieses Dokument ist für professionelle und nicht professionelle Kunden geeignet – ein nicht bindendes Dokument. Bitte beachten Sie vor dem Kauf die Verkaufsunterlagen, die im Internet unter www.la-francaise-systematic-am.com erhältlich sind. Quelle der Daten: La Française, Bloomberg



La Française Systematic European Equities I

ANLAGEKLASSE

in % des Fondsvermögens



Aktien	98.25%
Geldmarktfonds	0.96%
Kasse	0.79%

ICB-SEKTOREN

In % des Aktienanteils

Finanzgesellschaften	19.68%
Basiskonsumgüter	15.43%
Industriewerte	14.89%
Technologie	11.59%
Telekommunikation	10.39%
Nicht-Basiskonsumgüter	9.69%
Gesundheit	7.93%
Immobilien	6.18%
Energie	2.20%
Grundstoffe	2.01%

LAND

In % des Aktienanteils

Frankreich	25.93%
Großbritannien	13.40%
Deutschland	11.97%
Niederlande	8.43%
Schweiz	8.40%
Italien	5.32%
Finnland	4.94%
Belgien	4.55%
Schweden	4.09%
Norwegen	3.81%
Sonstige	9.15%

KAPITALISIERUNGSGRÖSSE

In % des Aktienanteils

Mittlere Kapi (1-5 Md€)	37.77%
Große Kapi (>5 Md€)	62.23%

CARBON FOOTPRINT

Finanzierte CO₂-Emissionen tCO₂e/investierter Mio. EUR

	Fonds	Universum*
Carbon footprint Deckungsrate	99.95%	93.60%
Carbon footprint	16.62	91.76

*Universum: Msci Europe Nr

TOP POSITIONEN

Ohne Geldmarkt

Aktien	Land	ICB-Sektoren	Gewichtung
Freetel Ag	Deutschland	Telekommunikation	2.16%
Gaztransport Et Technigaz Sa	Frankreich	Energie	2.16%
Swisscom Nom	Schweiz	Telekommunikation	2.15%
Teliasonera Ab	Schweden	Telekommunikation	2.15%
Bureau Veritas S	Frankreich	Industriewerte	2.14%
Coface Sa	Frankreich	Finanzgesellschaften	2.10%
Carrefour	Frankreich	Basiskonsumgüter	2.07%
Galenica Ag	Schweiz	Basiskonsumgüter	2.02%
Elisa Oyj -a Shr	Finnland	Telekommunikation	2.01%
Avast Plc	Tschechische Republik	Technologie	2.01%

Anzahl der Wertpapiere: 100

Top-10 Einzeltitel: 20.97%

KÄUFE/VERKÄUFE DES VERGANGENEN MONATS

Ohne Geldmarkt und in % des Nettoinventarwerts zum Transaktionsdatum

Neue Positionen	%	Saldierte Positionen	%
Premier Foods Plc	2.07%	Lundin Energy Ab	-3.22%
Cranswick	2.04%	Italgas	-2.86%
Veidekke Asa	2.01%	Snam Rete Gas	-2.85%
Man Group Plc/jersey	2.01%	Hera Spa	-2.75%
Verstärkte Positionen	%	Reduzierte Positionen	%
Keine verstärkte Position		Ipsos	-2.86%
		Rtl Group	-2.75%
		Computacenter	-2.66%
		Londonmetric Property Plc	-2.55%



La Française Systematic European Equities I

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

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 risikolos 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 Geldmarktverzinsung 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) wiedereinzuholen.