



LA FRANÇAISE

SYSTEMATIC ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht La Française Systematic ETF Portfolio Global

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 ETF Portfolio Global

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		59.084.452,06	100,09
1. Investmentanteile		58.030.259,82	98,30
- Deutschland	1.614.339,73		2,73
- Frankreich	2.380.413,30		4,03
- Irland	32.055.431,58		54,30
- Luxemburg	21.980.075,21		37,23
2. Derivate		-51.086,72	-0,09
3. Forderungen		681.698,83	1,15
4. Bankguthaben		423.580,13	0,72
II. Verbindlichkeiten		-53.300,19	-0,09
III. Fondsvermögen		59.031.151,87	100,00 ¹⁾

Fußnoten:

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

La Française Systematic ETF Portfolio Global

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									
Investmentanteile									
Gruppenfremde Investmentanteile									
Ausland									
IE00BHZPJ015	iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF		ANT	336.227	7.770	0	EUR 7,607	2.557.678,79	4,33
LU0292108619	Xtrackers MSCI EM Latin America ESG Swap UCITS ETF		ANT	6.602	0	0	EUR 35,400	233.710,80	0,40
LU1681046931	AIS-Amundi CAC 40		ANT	16.268	0	461	EUR 124,180	2.020.160,24	3,42
LU1861138961	AIS-Amundi MSCI EM SRI PAB		ANT	28.615	2.375	0	EUR 50,071	1.432.781,67	2,43
LU1437025023	AIS-MSCI UK IMI SRI PABFonds		ANT	2.953	0	334	EUR 806,100	2.380.413,30	4,03
IE000R85HL30	Am.ETF-M.US.SRI CL.N.Z.AMB.PABFonds		ANT	88.980	3.874	3.597	EUR 106,300	9.458.574,00	16,02
LU1753045332	BNP Paribas Easy - MSCI Europe SRI S-Series 5% Capped		ANT	39.131	2.650	0	EUR 32,283	1.263.277,81	2,14
LU1291106356	BNP Paribas Easy - MSCI Pacific ex Japan ex CW		ANT	97.271	0	8.932	EUR 13,344	1.298.023,13	2,20
LU1753045928	BNPPE-MSCI Jap.SRI S-Ser-5%C		ANT	135.596	11.829	7.584	EUR 20,735	2.811.623,74	4,76
LU1659681669	BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C.		ANT	454.398	15.585	22.548	EUR 19,733	8.966.726,61	15,19
DE000ETFL540	Deka MSCI Germ.Cl.Ch.ESG U.ETF		ANT	118.232	0	0	EUR 13,654	1.614.339,73	2,73
IE00BHZPJ908	iShsIV-MSCI USA ESG.Enh.U.ETFShares		ANT	1.086.391	0	16.999	EUR 9,240	10.038.252,84	17,01
LU1900066033	MUL-Lyx.MSCI Semic.ESG Flit.UE		ANT	7.627	0	7.411	EUR 52,532	400.661,56	0,68
LU2090063327	MUL-Lyx.MSCI Taiwan UCITS ETF		ANT	8.753	0	0	EUR 86,870	760.373,11	1,29
IE00BN4Q0602	UBS IRL ETF-MSCI USA CL.PA.AL.Shares		ANT	550.227	0	21.082	EUR 18,176	10.000.925,95	16,94
LU2250132763	UBS(L)FS-MSCI CH IMI Soc.Resp.		ANT	136.367	0	14.655	EUR 14,192	1.935.320,46	3,28
LU1953188833	UBS(L)FS-MSCI CN ESG Univ.ETF		ANT	116.687	0	22.353	EUR 7,348	857.416,08	1,45
Summe Wertpapiervermögen							EUR	58.030.259,82	98,30
Derivate								-51.086,72	-0,09
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
EURO STOXX 50 - FUTURE 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 48				-7.440,00	-0,01
EURO STOXX 50 - FUTURE 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				-160,00	0,00
MSCI EMERGING MARKETS INDEX 20/09/2024		ICE	USD	Anzahl 18				-14.275,72	-0,02
S&P 500 E-MINI FUTURE 20/09/2024		ICE	USD	Anzahl 32				-56.878,94	-0,10
Devisen-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Devisen-Terminkontrakte									
YEN DENOM NIKKEI 225 12/09/2024		EUREX	JPY	Anzahl 8				27.667,94	0,05
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	423.580,13	0,72
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Societe Generale Paris			JPY	15.630.471,00			% 100,000	90.663,09	0,15
Societe Generale Paris			USD	306.846,08			% 100,000	286.303,78	0,49
Verwahrstelle			GBP	42.108,69			% 100,000	49.665,26	0,08
Verwahrstelle			JPY	1.500.047,00			% 100,000	8.700,88	0,01
Verwahrstelle			PLN	59,57			% 100,000	13,83	0,00
Verwahrstelle			USD	21.581,24			% 100,000	20.136,45	0,03
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	681.698,83	1,15
Forderungen aus Anteilzeichnungen			EUR	1.194,21				1.194,21	0,00
Futures Variation Margin			EUR	7.600,00				7.600,00	0,01
Futures Variation Margin			JPY	-4.770.000,00				-27.667,94	-0,05
Futures Variation Margin			USD	76.260,00				71.154,65	0,12
Initial Margin			EUR	168.810,90				168.810,90	0,29
Initial Margin			JPY	7.480.000,00				43.387,04	0,07
Initial Margin			USD	447.155,50				417.219,97	0,71
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-31.903,16	-0,05
EUR-Kredite bei:									
Societe Generale Paris			EUR	-2.093,81			% 100,000	-2.093,81	0,00
Verwahrstelle			EUR	-29.809,35			% 100,000	-29.809,35	-0,05
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-53.300,19	-0,09
Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen			EUR	-7.078,50				-7.078,50	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse W)			EUR	-12.726,10				-12.726,10	-0,02
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse R)			EUR	-33.495,59				-33.495,59	-0,06

Fondsvermögen		EUR	59.031.151,87	100,00 ²⁾
Zurechnung auf Anteilscheinklassen:				
La Francaise System ETF Portfolio Global W				
Anteiliges Fondsvermögen		EUR	12.471.336,31	
Anteilwert		EUR	11,84	
Umlaufende Anteile		STK	1.052.900	
La Francaise System ETF Portfolio Global R				
Anteiliges Fondsvermögen		EUR	46.559.815,56	
Anteilwert		EUR	24,77	
Umlaufende Anteile		STK	1.879.803	

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)

Britisches Pfund	GBP	0,84785	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	JPY	172,4017	= 1 Euro (EUR)
Polnische Zloty	PLN	4,3085	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,07175	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

EUREX	European Exchange
ICE	Intercontinental Currency Exchange

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

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

	Anteile bzw. Whg. in 1.000	Zugänge	Abgänge	in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere				
Investmentanteile				
Gruppeneigene Investmentanteile				
FR0010609115	LA FRANCAISE - LF Trésorerie	ANT	17	18
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Terminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte				
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 - FUTURE, MSCI EMERGING MARKETS I, S&P 500 E-MINI FUTURE, YEN DENOM NIKKEI 225)				
				26.102
Verkaufte Kontrakte				
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 - FUTURE, MSCI EMERGING MARKETS I, S&P 500 E-MINI FUTURE, YEN DENOM NIKKEI 225)				
				9.385

La Française Systematic ETF Portfolio Global

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR -51.086,72

Das durch Derivate erzielte Exposure wurde gemäß § 16 Abs. 7 DerivateV ermittelt. Dabei wurden die Marktwerte der zugrundeliegenden Basiswerte EURO STOXX 50, MSCI EMERGING Markets, S&P 500 und YEN DENOM NIKKEI herangezogen.

Vertragspartner der derivativen Geschäfte

Societe Generale Paris

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem qualifizierten Ansatz ermittelt.

Sonstige Angaben

La Francaise System ETF Portfolio Global W

International Security Identification Number (ISIN)

DE000A3EEG13

Anteilwert

EUR

11,84

Umlaufende Anteile

STK

1.052.900

Auflagedatum

01.06.2023

Mindestanlagesumme

EUR

keine

Anleger

Private Anleger

Aktueller Ausgabeaufschlag

%

0,00

Aktueller Rücknahmeabschlag

%

0,00

Verwaltungsvergütung p. a.

%

1,20

Ertragsverwendung

ausschüttend

La Francaise System ETF Portfolio Global R

International Security Identification Number (ISIN)

DE000A0MKQK7

Anteilwert

EUR

24,77

Umlaufende Anteile

STK

1.879.803

Auflagedatum

01.04.2008

Mindestanlagesumme

EUR

keine

Anleger

Private Anleger

Aktueller Ausgabeaufschlag

%

5,00

Aktueller Rücknahmeabschlag

%

0,00

Verwaltungsvergütung p. a.

%

0,80

Ertragsverwendung

ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)

98,30

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)

-0,09

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 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