



La Française Systematic Multi Asset Allocation I



Vertriebszulassung: DE AT

WICHTIGE KENNZAHLEN

Nettoinventarwert : 1.011,95€

Fondsvermögen : 39,49 Mio.€

SYNTHETISCHE RISIKOINDIKATOR



ANLAGEHORIZONT



MERKMALE

Rechtsform : Investmentfonds-OGAW

Auflagedatum : 19/02/2014

Ertragsverwendung : Thesaurierend

Währung : EUR

Bewertungshäufigkeit : Täglich

Kundentyp : Institutionell

Hauptrisiken : Volatilität, Aktien, Zinssatz, Wechselkurs, Kredit

FONDSDETAILS

ISIN : DE000A0MKQQ4

Bloomberg Ticker : VERMAAI GR Equity

WKN : A0MKQQ

Orderannahmeschluss : T vor 11 Uhr

Settlement Buy/Sell : T+2 werktage

Mindestanlagesumme : 1 000 000 EUR

Ausgabeaufschlag max. : 0%

Rücknahmegebühr max. : 0%

Verwaltungsgebühren und sonstige administrative und betriebliche Kosten : 1.34% (31/12/2023)

Transaktionskosten : 0.22% (31/12/2023)

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 Fokus des Fonds liegt in der Generierung von Erträgen durch die Direktanlage in Aktien und Anleihen sowie über Investmentanteile u.a. ETFs. Bis zu 30% kann in Aktien und Aktienfonds investiert werden. Mit Derivaten kann die Investitionsquote auf bis zu 130% und die Aktienquote auf 49% gesteigert werden. Negative Wertentwicklungen sollen dabei auf 15% auf Jahresbasis begrenzt werden. Das Investmentvermögen ist nach dem InvStRefG als Mischfonds klassifiziert.

WERTENTWICKLUNG

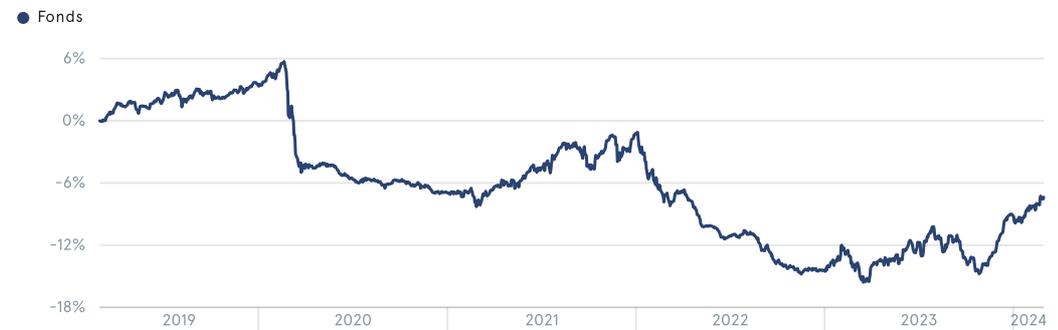
Berechnung nach BVI-Methode. Berechnungsbasis: Anteilwert (Ausgabeaufschläge nicht berücksichtigt), Ausschüttungen wieder angelegt. Anfallende Ausgabeaufschläge reduzieren das eingesetzte Kapital sowie die dargestellte Wertentwicklung. Liegen noch keine Werte über 5 Jahre vor, wird die Wertentwicklung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

| Kumuliert | 1 Monat | 3 Monate | lfd. Jahr | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | Seit Auflage |
|--------------|---------|----------|-----------|--------|---------|---------|--------------|
| Fonds | 1.43% | 5.32% | 1.79% | 7.79% | 1.00% | -7.38% | 3.79% |
| Annualisiert | | | | | 3 Jahre | 5 Jahre | Seit Auflage |
| Fonds | | | | | 0.33% | -1.52% | 0.37% |

WERTENTWICKLUNGSHISTORIE

| | Jan. | Feb. | Mar. | April | Mai | Juni | Juli | Aug. | Sept. | Okt. | Nov. | Dez. | Jahr |
|------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|
| 2024 Fonds | 0.35% | 1.43% | | | | | | | | | | | 1.79% |
| 2023 Fonds | 1.41% | -0.98% | -0.15% | 1.17% | -0.26% | 1.97% | 1.71% | -1.03% | -2.29% | -1.46% | 2.78% | 3.48% | 6.33% |
| 2022 Fonds | -3.72% | -2.26% | 0.19% | -2.27% | -1.32% | -1.05% | 0.68% | -1.90% | -1.56% | -0.49% | -0.44% | 0.05% | -13.31% |
| 2021 Fonds | -0.37% | -1.11% | 1.84% | 0.36% | 0.76% | 0.82% | 1.47% | 0.87% | -1.75% | 1.16% | -0.70% | 2.62% | 6.07% |
| 2020 Fonds | 0.95% | -3.80% | -5.12% | 0.31% | -0.09% | -1.19% | -0.08% | -0.62% | 0.37% | -0.46% | -0.41% | -0.27% | -10.09% |

WERTENTWICKLUNG ÜBER 5 JAHRE



FONDSKENNZAHLEN

| Wöchentliche Frequenz | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 5 Jahre |
|------------------------------|--------|---------|---------|---|
| Volatilität des Fonds | 6.10% | 5.00% | 4.99% | Max. Gewinn 9.85% (17/03/2023 -> 23/02/2024) |
| Sharpe ratio | 0.67 | -0.15 | -0.40 | Max. Verlust -20.15% (20/02/2020 -> 17/03/2023) |
| Value-at-Risk (99%, 10 Tage) | -2.40% | -2.41% | -2.45% | Recovery nicht erreicht |

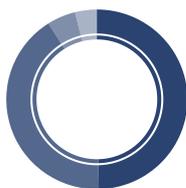
Dieses Dokument ist für professionelle und nicht professionelle Kunden geeignet – ein nicht bindendes Dokument. Bitte beachten Sie vor dem Kauf die Verkaufsunterlagen, die im Internet unter www.la-francaise-systematic-am.com erhältlich sind. Quelle der Daten: La Française, Bloomberg



La Française Systematic Multi Asset Allocation I

ANLAGEKLASSE

Netto-Exposure



| | |
|------------|--------|
| Anleihen | 59.64% |
| Aktien | 49.64% |
| Kasse | 6.11% |
| Geldmärkte | 4.70% |

AKTIENREGION

Netto-Exposure

| | |
|--------|--------|
| USA | 25.08% |
| Euro | 16.81% |
| Europa | 7.74% |

ANLEIHEN STRATEGIE

Netto-Exposure

| | |
|-------------|--------|
| Hochzins | 20.27% |
| Aggregiert | 15.22% |
| Staaten | 9.87% |
| ETF | 9.40% |
| Unternehmen | 4.88% |

TOP POSITIONEN

Ohne Geldmarkt

| Aktien | Gewichtung | Anleihen | Gewichtung |
|------------------------------|------------|---|------------|
| Ishares Euro Stoxx50 Ucits D | 5.23% | Ishares Eur Hy Corp Esg Eura | 10.17% |
| Cap Gemini | 0.53% | La Française Carbon Impact 2026 - Part S | 10.11% |
| Pandora A/s | 0.50% | La Française Obligations Carbon Impact - Pa | 10.09% |
| Siemens Ag-reg | 0.50% | Deka Db Eurogov Germany Ucit | 9.87% |
| Publicis | 0.50% | Ishares Eur Corp Esg 0-3y D | 9.40% |
| Stellantis Nv | 0.50% | Ishares Jpm Esg Usd Em Bd A Eur | 5.13% |
| Novo Nordisk A/s-b | 0.50% | Xtrackers Esg Usd Emerging Markets Bond Q | 4.88% |
| Rep Sm | 0.49% | | |
| Abb Ltd | 0.48% | | |
| Sage Group Plc/the | 0.48% | | |

Anzahl der Wertpapiere: 110

Top-10 Einzeltitel: 65.90%

KÄUFE/VERKÄUFE DES VERGANGENEN MONATS

Ohne Geldmarkt und in % des Nettoinventarwerts zum Transaktionsdatum

| Neue Positionen | % | Saldierte Positionen | % |
|---------------------------|---|------------------------------|--------|
| Keine neue Position | | Keine reduzierte Position | |
| Verstärkte Positionen | % | Reduzierte Positionen | % |
| Keine verstärkte Position | | Ishares Euro Stoxx50 Ucits D | -0.83% |



La Française Systematic Multi Asset Allocation 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

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.

Berechnungsbasis der Performance Fee : Sofern die Anteilwertentwicklung positiv ist bzw. die angegebene Hurdlerate übersteigt, fällt vom übersteigenden Betrag eine zusätzliche Vergütung in Höhe des angegebenen Prozentsatzes an. Die Berechnung erfolgt jeweils für ein volles Kalenderjahr, bei börsentäglicher Abgrenzung. Die zusätzliche Vergütung setzt eine positive Wertentwicklung gegenüber den vorangegangenen fünf Abrechnungsstichtagen voraus (High Watermark).

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 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) wiederinzuholen.