

Halbjahresbericht La Française Systematic ETF Portfolio Global

vom 01.01.2026 bis 30.06.2026

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
Mark Wolter

www.la-francaise-systematic-am.com

La Française Systematic ETF Portfolio Global

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2026

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		65.182.145,73	100,18
1. Investmentanteile		63.142.377,99	97,05
- Deutschland	1.515.422,75		2,33
- Frankreich	725.580,18		1,12
- Irland	46.140.391,37		70,92
- Luxemburg	14.760.983,69		22,69
2. Derivate		34.055,19	0,05
3. Forderungen		287,70	0,00
4. Bankguthaben		814.366,96	1,25
5. Sonstige Vermögensgegenstände		1.191.057,89	1,83
II. Verbindlichkeiten		-119.647,07	-0,18
III. Fondsvermögen		65.062.498,66	100,00 ¹⁾

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

La Française Systematic ETF Portfolio Global

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2026

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2026	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Investmentanteile									
Gruppeneigene Investmentanteile									
FR0010609115	LA FRANCAISE - LF Trésorerie		ANT	6	30	25	EUR 118.947,570	725.580,18	1,12
							EUR	725.580,18	1,12
Gruppenfremde Investmentanteile									
LU1681046931	AIS-Amundi CAC 40		ANT	11.709	0	0	EUR 149,360	1.748.856,24	2,69
LU1437025023	AIS-MSCI UK IMI SRI PAB		ANT	2.386	0	0	EUR 1.046,200	2.496.233,20	3,84
LU1681042609	Amundi Index Solutions - Amundi Index MSCI Europe ESG Broad CTB		ANT	2.356	0	0	EUR 442,300	1.042.058,80	1,60
IE0006IP4XZ8	Amundi MSCI USA ESG Climate Net Zero Ambition CTB UCITS ETF		ANT	15.514	0	1.442	EUR 659,780	10.235.826,92	15,73
LU1291102447	BNP Paribas Easy - MSCI Japan ex CW		ANT	144.357	0	18.305	EUR 20,203	2.916.458,91	4,48
LU1291106356	BNP Paribas Easy - MSCI Pacific ex Japan ex CW		ANT	77.505	0	30.079	EUR 16,529	1.281.087,90	1,97
DE000ETFL540	Deka MSCI Germ.Cl.Ch.ESG U.ETF		ANT	90.473	0	9.993	EUR 16,750	1.515.422,75	2,33
IE000RLUE8E9	Invesco MSCI USA ESG Climate Paris Aligned UCITS ETF		ANT	1.772.020	33.978	48.417	EUR 5,975	10.587.819,50	16,27
IE00BHZPJ015	iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF		ANT	270.341	0	15.482	EUR 10,544	2.850.475,50	4,38
IE00BHZPJ908	iShsIV-MSCI USA ESG.Enh.U.ETF		ANT	872.573	0	72.724	EUR 11,770	10.270.184,21	15,79
IE00BN4Q1675	MSCI EMERGING MARKETS CLIMATE PA- RIS ALIGNED UCITS ETF		ANT	105.126	12.994	10.148	EUR 16,394	1.723.435,64	2,65
LU1900066033	MUL-Lyx.MSCI Semic.ESG Filt.UE		ANT	5.911	0	1.576	EUR 122,250	722.619,75	1,11
LU2090063327	MUL-Lyx.MSCI Taiwan UCITS ETF		ANT	7.822	0	0	EUR 202,800	1.586.301,60	2,44
IE00BN4Q0602	UBS IRL ETF-MSCI USA CL.PA.AL.		ANT	467.529	0	16.301	EUR 22,400	10.472.649,60	16,10
LU2250132763	UBS(L)FS-MSCI CH IMI Soc.Resp.		ANT	106.841	0	6.893	EUR 17,324	1.850.913,48	2,84
LU1953188833	UBS(L)FS-MSCI CN ESG Univ.ETF		ANT	99.953	0	9.143	EUR 8,704	869.990,91	1,34
LU0292108619	Xtrackers MSCI EM Latin America ESG Swap UCITS ETF		ANT	5.065	5.065	0	EUR 48,660	246.462,90	0,38
Summe Wertpapiervermögen							EUR	62.416.797,81	95,93
							EUR	63.142.377,99	97,05
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	127.140,99	0,20
Aktienindex-Terminkontrakte									
EURO STOXX 50 - FUTURE 18/09/2026			EUREX	EUR	Anzahl 16			9.680,00	0,01
EURO STOXX 50 - FUTURE 18/09/2026			EUREX	EUR	Anzahl 40			21.600,00	0,03
MSCI EMERGING MARKETS INDEX 18/09/2026			ICE	USD	Anzahl 2			2.212,89	0,00
MSCI EMERGING MARKETS INDEX 18/09/2026			ICE	USD	Anzahl 3			3.319,34	0,01
MSCI EMERGING MARKETS INDEX 18/09/2026			ICE	USD	Anzahl 4			4.425,79	0,01
MSCI EMERGING MARKETS INDEX 18/09/2026			ICE	USD	Anzahl 1			1.106,45	0,00
MSCI EMERGING MARKETS INDEX 18/09/2026			ICE	USD	Anzahl 1			1.106,45	0,00
MSCI EMERGING MARKETS INDEX 18/09/2026			ICE	USD	Anzahl 1			1.106,45	0,00
S&P 500 E-MINI FUTURE 18/09/2026			CME	USD	Anzahl 4			8.632,90	0,01
S&P 500 E-MINI FUTURE 18/09/2026			CME	USD	Anzahl 1			-2.066,39	0,00
S&P 500 E-MINI FUTURE 18/09/2026			CME	USD	Anzahl 6			11.873,52	0,02
S&P 500 E-MINI FUTURE 18/09/2026			CME	USD	Anzahl 18			35.620,57	0,05
YEN DENOM NIKKEI 225 10/09/2026			CME	JPY	Anzahl 1			16.252,74	0,02
YEN DENOM NIKKEI 225 10/09/2026			CME	JPY	Anzahl 4			12.270,28	0,02
Devisen-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	-93.085,80	-0,14
Devisen-Terminkontrakte									
EURO FX CURR FUT (CME) 14/09/2026			CME	USD	Anzahl 44			-93.085,80	-0,14
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:							EUR	814.366,96	1,25
Societe Generale Paris			EUR	954.596,82			% 100,000	954.596,82	1,47
Verwahrstelle			EUR	66.625,51			% 100,000	66.625,51	0,10
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle			PLN	59,57			% 100,000	13,86	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Societe Generale Paris			JPY	38.881.691,00			% 100,000	209.249,70	0,32
Verwahrstelle			GBP	42.108,69			% 100,000	48.884,01	0,08
Verwahrstelle			JPY	1.500.001,05			% 100,000	8.072,56	0,01
Verwahrstelle			USD	21.584,89			% 100,000	18.879,46	0,03

Sonstige Vermögensgegenstände						EUR			1.191.345,59	1,83
Forderungen aus Anteilzeichnungen	EUR	287,70							287,70	0,00
Futures Variation Margin	USD	29.437,50							25.747,84	0,04
Initial Margin	EUR	252.412,20							252.412,20	0,39
Initial Margin	JPY	13.871.241,00							74.650,89	0,11
Initial Margin	USD	958.367,75							838.246,96	1,29
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme						EUR			-491.954,96	-0,76
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen										
Societe Generale Paris	USD	-562.452,11				%	100,000		-491.954,96	-0,76
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR			-119.647,07	-0,18
Futures Variation Margin	EUR	-31.280,00							-31.280,00	-0,05
Futures Variation Margin	JPY	-5.300.000,00							-28.523,02	-0,04
Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen	EUR	-4.751,32							-4.751,32	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse W)	EUR	-15.692,47							-15.692,50	-0,02
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse R)	EUR	-39.400,21							-39.400,24	-0,06
Fondsvermögen						EUR			65.062.498,66	100,00²⁾
Zurechnung auf Anteilscheinklassen:										
La Francaise Systematic ETF Portfolio Global W										
Anteiliges Fondsvermögen						EUR			14.240.333,64	
Anteilwert						EUR			14,52	
Umlaufende Anteile						STK			980.532	
La Francaise Systematic ETF Portfolio Global R										
Anteiliges Fondsvermögen						EUR			50.822.165,02	
Anteilwert						EUR			30,61	
Umlaufende Anteile						STK			1.660.130	

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 30.06.2026

Devisenkurse (in Mengennotiz)

Schweizer Franken	CHF	0,92225 = 1 EUR
Britische Pfund	GBP	0,8614 = 1 EUR
Japanische Yen	JPY	185,8148 = 1 EUR
Polnische Zloty	PLN	4,2975 = 1 EUR
US-Dollar	USD	1,1433 = 1 EUR

Marktschlüssel

EUREX	European Exchange
ICE	Intercontinental Currency Exchange
CME	Chicago Mercantile 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):

Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)	Volumen in 1.000
Terminkontrakte	
Aktienindex-Terminkontrakte	
Gekaufte Kontrakte (Basiswert(e): EURO STOXX 50 - FUTURE, MSCI EMERGING MARKETS -FUTURE, S&P 500 E-MINI FUTURE, YEN DENOM NIKKEI 225)	41.560
Verkaufte Kontrakte (Basiswert(e): EURO STOXX 50 - FUTURE, MSCI EMERGING MARKETS -FUTURE, S&P 500 E-MINI FUTURE, YEN DENOM NIKKEI 225)	30.962
Devisen-Derivate	
Terminkontrakte auf Devisen	
Gekaufte Kontrakte (Basiswert(e): Euro FX Curr Futures)	41.990

La Française Systematic ETF Portfolio Global

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung		
Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	34.055,19
Vertragspartner der derivativen Geschäfte		
Societe Generale Paris		
Sonstige Angaben		
La Francaise System ETF Portfolio Global W		
International Security Identification Number (ISIN)		DE000A3EEG13
Anteilwert	EUR	14,52
Umlaufende Anteile	STK	980.532
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	30,61
Umlaufende Anteile	STK	1.660.130
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 %)		97,05
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)		0,05
Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände		
Verbindlichkeiten		
Fremdwährungsumrechnung		

Frankfurt am Main, den 06. August 2026

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
€ 5,0 Mio., Stand 31.12.2025
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
€ 2,6 Mio., Stand 31.12.2025

Gesellschafter

Groupe La Française
Paris

Geschäftsführer

Berit Jauch
20355 Hamburg

Dennis Jeske
63128 Dietzenbach

Mark Wolter
53925 Kall

Verwahrstelle

BNP Paribas S.A.
Niederlassung Deutschland
Senckenberganlage 19
60325 Frankfurt am Main
Haftendes Eigenkapital: € 98.265 Mio.
Stand 31.12.2025

Wirtschaftsprüfer

FFA Frankfurt Finance Audit GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Isabelle Kintz-Blouquy

Relationship Management der Groupe
La Française International Entities
LFFS Luxembourg Branch, Luxembourg
Vorsitzende

Paul Gurzal

Co-Head of Fixed Income & Head Quantitative Hub
Credit Mutuel Asset Management, Frankreich
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 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