



LA FRANÇAISE

SYSTEMATIC ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht La Française Systematic ETF Dachfonds

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 Dachfonds

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		55.070.314,42	100,17
1. Investmentanteile		54.778.844,96	99,64
- Frankreich	56.440,52		0,10
- Irland	14.581.518,78		26,52
- Luxemburg	40.140.885,66		73,01
2. Derivate		3.578,26	0,01
3. Forderungen		11.972,57	0,02
4. Bankguthaben		275.918,63	0,50
II. Verbindlichkeiten		-91.984,59	-0,17
III. Fondsvermögen		54.978.329,83	100,00 ¹⁾

Fußnoten:

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

La Française Systematic ETF Dachfonds

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Investmentanteile										
Gruppeneigene Investmentanteile										
Ausland										
FR0010609115	LA FRANCAISE - LF Trésorerie		ANT	1	15	22	EUR 112.881,030	56.440,52	0,10	
								EUR	56.440,52	0,10
Gruppenfremde Investmentanteile										
Ausland										
LU1806495575	AIS-Amun.Idx US Corp. SRI		ANT	24.325	25.760	1.435	EUR 53,120	1.292.144,00	2,35	
LU1681041114	AIS-Amundi EUR F.R.Corp.Bd ESGAnteile		ANT	11.592	11.592	0	EUR 106,200	1.231.070,40	2,24	
IE000Y77LGG9	Am.ETF-MSCI W.SRI CL.N.Z.AM.P.Shares		ANT	49.350	50.411	1.061	EUR 95,390	4.707.496,50	8,56	
LU2300294316	Am.Idx Sol.Amu.EUR C.0-1 Y ESGFonds		ANT	23.486	23.486	0	EUR 52,136	1.224.466,10	2,23	
LU1859444769	BNP P.E.-EO Corp Bd.SRI Fo.Fr.		ANT	109.297	123.158	13.861	EUR 9,886	1.080.553,86	1,97	
LU1291101555	BNP P.Easy-MSCI Eu.S.C.SRI S-S		ANT	5.006	378	296	EUR 277,874	1.391.035,74	2,53	
LU2008763935	BNP PE-FTSE E/N Dv.Eur.xUK Grn		ANT	152.090	21.480	6.008	EUR 6,646	1.010.805,35	1,84	
LU1753045415	BNPPE-MSCI Eur.SRI S-Ser.5%C.		ANT	72.162	4.044	121.742	EUR 28,232	2.037.299,23	3,71	
LU1753045928	BNPPE-MSCI Jap.SRI S-Ser.5%C.		ANT	69.645	13.451	65.881	EUR 20,735	1.444.109,97	2,63	
LU1659681669	BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C.		ANT	301.981	29.094	66.195	EUR 19,733	5.959.051,47	10,84	
IE00BJK55C48	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF		ANT	207.681	234.588	26.907	EUR 5,237	1.087.604,63	1,98	
IE00BF553838	iShs II-J.P.M.ESG \$ EM B.U.ETF		ANT	271.418	271.418	0	EUR 5,005	1.358.555,66	2,47	
IE00B3VWM098	iShs VII-MUSSCEEH UC.ETFShares		ANT	1.424	0	100	EUR 456,430	649.956,32	1,18	
IE00BYZTVV78	iShsII-EO C.Bd 0-3yr ESG U.ETF		ANT	218.479	247.237	28.758	EUR 4,917	1.074.239,40	1,95	
IE00BJP26D89	iShsIV-EO Ultrash.Bd ESG U.ETFShares		ANT	199.056	239.347	40.291	EUR 5,017	998.743,57	1,82	
IE00BYX2JD69	iShsIV-MSCI Wld.SRI UCITS ETF		ANT	426.325	0	19.111	EUR 11,036	4.704.922,70	8,56	
LU2197908721	M.U.L.-Amundi Nasdaq-100 UC.ETF		ANT	28.044	3.565	3.907	EUR 195,880	5.493.258,72	9,99	
LU1563454310	MUL-Lyxor Green Bond(DR)UC.ETF		ANT	58.180	0	4.937	EUR 47,162	2.743.885,16	4,99	
LU0629460832	UBS(L)FS MSCI Pac.Soc.Resp.UE		ANT	10.932	1.837	10.150	EUR 70,940	775.516,08	1,41	
LU1484799769	UBS(L)FS-BB MSCI EO A.L.C.Sus.		ANT	83.690	0	146.945	EUR 12,932	1.082.279,08	1,97	
LU1048313891	UBS(L)FS-MSCI EM Soc.Res.U.ETF		ANT	204.379	204.379	0	EUR 12,338	2.521.628,10	4,59	
LU0629460089	UBS(L)FS-MSCI USA SR UCITS ETF		ANT	29.980	2.397	7.454	EUR 203,780	6.109.324,40	11,11	
LU0629459743	UBS(L)FS-MSCI World Soc. Resp.		ANT	31.842	0	2.442	EUR 149,000	4.744.458,00	8,63	
								EUR	54.722.404,44	99,53
Summe Wertpapiervermögen								EUR	54.778.844,96	99,64
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
Aktienindex-Derivate										
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte										
MSCI EMERGING MARKETS INDEX 20/09/2024		EUREX	USD	Anzahl -1				1.982,74	0,00	
MSCI EMERGING MARKETS INDEX 20/09/2024		EUREX	USD	Anzahl -1				797,76	0,00	
S&P 500 E-MINI FUTURE 15/09/2023		EUREX	USD	Anzahl -1				797,76	0,00	
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds										
								EUR	275.918,63	0,50
EUR-Guthaben bei:										
Societe Generale Paris			EUR	252.467,02			% 100,000	252.467,02	0,46	
Verwahrstelle			EUR	54.635,61			% 100,000	54.635,61	0,10	
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
Societe Generale Paris			JPY	1.693.011,00			% 100,000	9.820,15	0,02	
Verwahrstelle			JPY	5.693,00			% 100,000	33,02	0,00	
Verwahrstelle			USD	7.551,02			% 100,000	7.045,51	0,01	
Sonstige Vermögensgegenstände										
								EUR	11.972,57	0,02
Forderungen aus Anteilzeichnungen			EUR	16,89				16,89	0,00	
Futures Variation Margin			USD	-3.835,00				-3.578,26	-0,01	
Initial Margin			USD	16.648,50				15.533,94	0,03	
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme										
								EUR	-48.082,68	-0,09
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen										
Societe Generale Paris			USD	-51.532,61			% 100,000	-48.082,68	-0,09	
Sonstige Verbindlichkeiten										
								EUR	-91.984,59	-0,17
Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen			EUR	-17.963,07				-17.963,07	-0,03	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse I)			EUR	-1.067,84				-1.067,84	0,00	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse S)			EUR	-28,91				-28,91	0,00	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse P)			EUR	-72.924,77				-72.924,77	-0,13	
Fondsvermögen								EUR	54.978.329,83	100,00 ²⁾

Zurechnung auf Anteilscheinklassen:

La Française Systematic ETF Dachfonds I			
Anteiliges Fondsvermögen	EUR		1.530.639,46
Anteilwert	EUR		19,34
Umlaufende Anteile	STK		79.157
La Française Systematic ETF Dachfonds W			
Anteiliges Fondsvermögen	EUR		21.293,54
Anteilwert	EUR		13,96
Umlaufende Anteile	STK		1.526
La Française Systematic ETF Dachfonds P			
Anteiliges Fondsvermögen	EUR		53.426.396,83
Anteilwert	EUR		16,93
Umlaufende Anteile	STK		3.155.209

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)

Japanische Yen	JPY	172,4017	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,07175	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

EUREX European 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):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Investmentanteile					
Gruppenfremde Investmentanteile					
LU1861138961	AIS-Amundi MSCI EM SRI PAB	ANT	0	67.513	
LU1861134382	AIS-AMUNDI MSCI WORLD SRI	ANT	0	914	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte					
(Basiswerte: S&P 500 E-MINI FUTURE, EURO STOXX 50 - FUTURE, MSCI EMERGING MARKETS I, YEN DENOM NIKKEI 225)					14.607

La Française Systematic ETF Dachfonds

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure

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

EUR 3.578,26

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 Française Systematic ETF Dachfonds I

International Security Identification Number (ISIN)

Anteilwert EUR 19,34

Umlaufende Anteile STK 79.157

Auflagedatum 16.04.2008

Mindestanlagesumme EUR 100.000

Anleger Institutionelle Anleger

Aktueller Ausgabeaufschlag % 0,00

Aktueller Rücknahmeabschlag % 0,00

Verwaltungsvergütung p. a. % 0,60

Ertragsverwendung ausschüttend

La Française Systematic ETF Dachfonds W

International Security Identification Number (ISIN)

Anteilwert EUR 13,96

Umlaufende Anteile STK 1.526

Auflagedatum 02.09.2013

Mindestanlagesumme keine

Anleger Private Anleger

Aktueller Ausgabeaufschlag % 5,00

Aktueller Rücknahmeabschlag % 0,00

Verwaltungsvergütung p. a. % 1,50

Ertragsverwendung ausschüttend

La Française Systematic ETF Dachfonds P

International Security Identification Number (ISIN)

Anteilwert EUR 16,93

Umlaufende Anteile STK 3.155.209

Auflagedatum 02.04.2007

Mindestanlagesumme keine

Anleger Private Anleger

Aktueller Ausgabeaufschlag % 0,00

Aktueller Rücknahmeabschlag % 0,00

Verwaltungsvergütung p. a. % 1,50

Ertragsverwendung ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 99,64

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 0,01

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 Gesamtrendite-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