



LA FRANÇAISE
SYSTEMATIC ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht La Française Systematic ETF Dachfonds

vom 01.01.2023 bis 30.06.2023

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 Hamann
Dennis Jeske
Kay Scherf
Mark Wolter

www.la-francaise-systematic-am.com

La Française Systematic ETF Dachfonds

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		56.929.983,37	100,15
1. Investmentanteile		56.133.907,66	98,75
- Frankreich	325.461,24		0,57
- Irland	5.750.259,90		10,12
- Luxemburg	50.058.186,52		88,06
2. Derivate		8.183,06	0,01
3. Forderungen		508,86	0,00
4. Bankguthaben		435.937,80	0,77
5. Sonstige Vermögensgegenstände		351.445,99	0,62
II. Verbindlichkeiten		-86.336,14	-0,15
III. Fondsvermögen		56.843.647,23	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 2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	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	3	18	17	EUR 108.487,08	325.461,24	0,57	
Gruppenfremde Investmentanteile										
Ausland										
LU1861138961	AIS-Amundi MSCI EM SRI PABFonds		ANT	68.397	0	0	EUR 48,489	3.316.502,13	5,83	
LU1861134382	AIS-AMUNDI MSCI WORLD SRI		ANT	59.802	0	0	EUR 83,680	5.004.231,36	8,80	
LU1291101555	BNP P.Easy-MSCI Eu.S.C.SRI S-S		ANT	5.147	0	0	EUR 251,284	1.293.356,69	2,28	
LU2008763935	BNP PE-FTSE E/N Dv.Eur.xUK Grn		ANT	145.611	0	0	EUR 5,535	805.942,32	1,42	
LU1753045415	BNPPE-MSCI Eur.SRI S-Ser.5%C.		ANT	204.262	0	11.358	EUR 25,915	5.293.449,73	9,31	
LU1753045928	BNPPE-MSCI Jap.SRI S-Ser-5%C		ANT	127.607	0	0	EUR 21,778	2.778.974,20	4,89	
LU1659681669	BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C.		ANT	392.385	0	0	EUR 17,464	6.852.690,12	12,06	
IE00B3VVM098	iShs VII-MUSSCEEH UC.ETFShares		ANT	1.761	0	0	EUR 414,980	730.779,78	1,29	
IE00BYX2JD69	iShsIV-MSCI Wld.SRI UCITS ETF		ANT	525.270	60.374	0	EUR 9,556	5.019.480,12	8,83	
LU2197908721	M.U.L.-Lyxor Nasdaq-100 UC.ETF		ANT	35.340	0	5.000	EUR 146,300	5.170.242,00	9,10	
LU1563454310	MUL-Lyxor Green Bond(DR)UC.ETF		ANT	63.117	2.690	0	EUR 45,283	2.858.127,11	5,03	
LU0629460832	UBS(L)FS MSCI Pac.Soc.Resp.UE		ANT	21.218	0	0	EUR 67,120	1.424.152,16	2,51	
LU1484799769	UBS(L)FS-BB MSCI EO A.L.C.Sus.		ANT	230.635	7.648	0	EUR 12,458	2.873.250,83	5,05	
LU0629460089	UBS(L)FS-MSCI USA SR UCITS ETF		ANT	43.437	0	0	EUR 168,210	7.306.537,77	12,85	
LU0629459743	UBS(L)FS-MSCI World Soc. Resp.		ANT	41.073	4.726	0	EUR 123,700	5.080.730,10	8,94	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	56.133.907,66	98,75
Derivate									8.183,06	0,01
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
Aktienindex-Derivate									65.685,96	0,12
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte										
EURO STOXX 50 - FUTURE 15/09/2023		EUREX	EUR	Anzahl -24				-5.165,00		
EURO STOXX 50 - FUTURE 15/09/2023		EUREX	EUR	Anzahl -30				-12.600,00		
MSCI EMERGING Markets - FUTURE 15/09/2023		ICE	USD	Anzahl -5				6.209,90		
MSCI EMERGING Markets - FUTURE 15/09/2023		ICE	USD	Anzahl -2				2.483,96		
MSCI EMERGING Markets - FUTURE 15/09/2023		ICE	USD	Anzahl -49				60.857,01		
MSCI EMERGING Markets - FUTURE 15/09/2023		ICE	USD	Anzahl -17				21.113,66		
MSCI EMERGING Markets - FUTURE 15/09/2023		ICE	USD	Anzahl -1				1.241,98		
S&P 500 E-MINI FUTURE 15/09/2023		ICE	USD	Anzahl -30				-8.455,55		
Devisen-Derivate									-57.502,90	-0,10
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Devisen-Terminkontrakte										
YEN DENOM NIKKEI 225 07/09/2023		EUREX	JPY	Anzahl -13				-57.502,90	-0,10	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR	435.937,80	0,77
EUR-Guthaben bei:										
Societe Generale Paris			EUR	514.795			% 100,000	514.794,51	0,91	
Verwahrstelle			EUR	47.278,36			% 100,000	47.278,36	0,08	
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
Societe Generale Paris			JPY	-26.818.204,00			% 100,000	-170.071,63	-0,30	
Societe Generale Paris			USD	40.344,58			% 100,000	36.979,45	0,07	
Verwahrstelle			JPY	5.693,00			% 100,000	36,10	0,00	
Verwahrstelle			USD	7.550,82			% 100,000	6.921,01	0,01	
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR	351.954,85	0,62
Forderungen aus Anteilzeichnungen			EUR	508,86				508,86		
Futures Variation Margin			EUR	17.765,00				17.765,00	0,03	
Futures Variation Margin			JPY	9.067.500,00				57.502,90	0,10	
Futures Variation Margin			USD	-91.045,00				-83.450,96	-0,15	
Initial Margin			EUR	163.253,30				163.253,30	0,29	
Initial Margin			JPY	8.866.000,00				56.225,06	0,10	
Initial Margin			USD	152.904,40				140.150,69	0,25	
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR	-86.336,14	-0,15
Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen			EUR	-3.250,14				-3.250,14	-0,01	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse I)			EUR	-1.061,79				-1.061,79	0,00	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse W)			EUR	-40,41				-40,41	0,00	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse P)			EUR	-81.983,80				-81.983,80	-0,14	
Fondsvermögen								EUR	56.843.647,23	100,00 ¹⁾

Zurechnung auf Anteilscheinklassen:

La Française Systematic ETF Dachfonds I

Anteiliges Fondsvermögen

Anteilwert

Umlaufende Anteile

EUR 1.446.629,40

EUR 17,54

STK 82.476

La Française Systematic ETF Dachfonds W

Anteiliges Fondsvermögen

Anteilwert

Umlaufende Anteile

EUR 27.487,94

EUR 12,77

STK 2.153

La Française Systematic ETF Dachfonds P

Anteiliges Fondsvermögen

Anteilwert

Umlaufende Anteile

EUR 55.369.529,89

EUR 15,50

STK 3.572.797

Fußnoten:

1) 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 30.06.2023

Devisenkurse (in Mengennotiz)

Japanische Yen	JPY	157,6877	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	USD	1,091	= 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 (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000	
Börsengehandelte Wertpapiere						
Gruppenfremde Investmentanteile						
Ausland						
LU1048313891	UBS(L)FS-MSCI EM Soc.Res.U.ETF	ANT	0	123.986		
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)						
Terminkontrakte						
Aktienindex-Terminkontrakte						
Verkaufte Kontrakte (Basiswert(e): MSCI EMERGING, YEN DENOM NIKKEI 225, S&P 500 E-MINI)						32.447

La Française Systematic ETF Dachfonds

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR **8.183,06**
 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 einfachen Ansatz ermittelt.

Sonstige Angaben

La Française Systematic ETF Dachfonds I			DE000A0MKQL5
International Security Identification Number (ISIN)			
Anteilwert	EUR		17,54
Umlaufende Anteile	STK		82.476
Anleger		Private Anleger	
Aktueller Ausgabeaufschlag	%		0,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%		0,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%		0,60
Ertragsverwendung			ausschüttend

La Française Systematic ETF Dachfonds W			DE000A0MKQH3
International Security Identification Number (ISIN)			
Anteilwert	EUR		12,77
Umlaufende Anteile	STK		2.153
Anleger		Private Anleger	
Aktueller Ausgabeaufschlag	%		5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%		0,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%		1,50
Ertragsverwendung			ausschüttend

La Française Systematic ETF Dachfonds P			DE0005561674
International Security Identification Number (ISIN)			
Anteilwert	EUR		15,50
Umlaufende Anteile	STK		3.572.797
Anleger		Private Anleger	
Aktueller Ausgabeaufschlag	%		0,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%		0,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%		1,50
Ertragsverwendung			ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	98,75
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 30.06.2023 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 30.06.2023 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, August 2023

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

€ 7,4 Mio., Stand 31.12.2022

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital

€ 2,6 Mio., Stand 31.12.2022

Gesellschafter

Groupe La Française

Paris

Geschäftsführer

Berit Hamann, 20355 Hamburg

Dennis Jeske, 20144 Hamburg

Kay Scherf, 63110 Rodgau

Mark Wolter, 50937 Köln

Verwahrstelle

BNP Paribas S.A.

Niederlassung Deutschland

Senckenberganlage 19

60325 Frankfurt am Main

Haftendes Eigenkapital: € 120.562 Mio.

Stand 31.12.2022

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

Groupe 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 9757 43 -0

Fax: +49 (0) 69 9757 43 -81

info-am@la-francaise.com

www.la-francaise-systematic-am.com