



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)

DE000A0MKQL5

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)

DE000A0MKQH3

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)

DE0005561674

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