



LA FRANÇAISE

SYSTEMATIC ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht La Française Systematic ETF Dachfonds

vom 01.01.2022 bis 30.06.2022

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

www.la-francaise-systematic-am.com

La Française Systematic ETF Dachfonds

Vermögensübersicht zum 30.06.2022

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		59.556.659,93	100,17
1. Investmentanteile		55.759.152,69	93,78
- Frankreich	522.941,23		0,88
- Irland	5.661.823,36		9,52
- Luxemburg	49.574.388,10		83,38
2. Derivate		100.446,32	0,17
3. Bankguthaben		1.472.195,10	2,48
4. Sonstige Vermögensgegenstände		2.224.865,82	3,74
II. Verbindlichkeiten		-98.111,53	-0,17
III. Fondsvermögen		59.458.548,40	100,00 ¹⁾

La Française Systematic ETF Dachfonds

Vermögensaufstellung zum 30.06.2022

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2022	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsvermögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Investmentanteile									
Gruppeneigene Investmentanteile									
FR0010609115	LA FRANCAISE - LF Trésorerie		ANT	5	62	60	EUR 106.722,70 0	522.941,23	0,88
Gruppenfremde Investmentanteile									
LU1861134382	AIS-AMUNDI MSCI WORLD SRI		ANT	66.924	4.580	2.432	EUR 72,780	4.870.728,72	8,19
LU1291101555	BNP P.Easy-MSCI Eu.S.C.SRI S-S		ANT	5.147	0	0	EUR 250,944	1.291.609,80	2,17
LU2008763935	BNP PE-FTSE E/N Dv.Eur.xUK Grn		ANT	145.611	35.637	0	EUR 7,146	1.040.507,08	1,75
LU1753045415	BNPPE-MSCI Eur.SRI S-Ser.5%C.		ANT	238.158	36.473	25.832	EUR 24,091	5.737.345,30	9,65
LU1753045928	BNPPE-MSCI Jap.SRI S-Ser.5%C		ANT	141.689	18.208	0	EUR 20,687	2.931.120,34	4,93
LU1659681669	BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C.		ANT	454.295	56.164	32.926	EUR 15,901	7.223.926,51	12,15
IE00B60SX402	InvescoMI Russell 2000 ETF		ANT	4.422	0	0	EUR 79,720	352.521,84	0,59
IE00B1XNHC34	iShsII-Gl.Clean Energy U.ETF		ANT	154.051	0	0	EUR 10,390	1.600.589,89	2,69
IE00BYX2JD69	iShsIV-MSCI Wld.SRI UCITS ETF		ANT	402.088	24.373	33.928	EUR 8,310	3.341.351,28	5,62
IE00B3CNHJ55	L+G-L&G Ru.2000 US S.C.Q.UETF		ANT	4.965	0	0	EUR 73,990	367.360,35	0,62
LU2197908721	M.U.L.-Lyxor Nasdaq-100 UC.ETF		ANT	37.149	0	2.431	EUR 115,960	4.307.798,04	7,25
LU1769088581	MUL-Lyx.MSCI EM ESG Le.Ex.U.E.		ANT	197.420	21.825	35.727	EUR 17,620	3.478.540,40	5,85
LU1563454310	MUL-Lyxor Green Bond(DR)UC.ETF		ANT	49.859	16.465	47.327	EUR 47,057	2.346.214,96	3,95
LU0629460832	UBS(L)FS MSCI Pac.Soc.Resp.UE		ANT	23.902	0	0	EUR 63,420	1.515.864,84	2,55
LU1484799769	UBS(L)FS-BB MSCI EO A.L.C.Sus.		ANT	182.966	60.678	178.579	EUR 12,566	2.299.150,76	3,87
LU1048313891	UBS(L)FS-MSCI EM Soc.Res.U.ETF		ANT	119.719	0	0	EUR 12,178	1.457.937,98	2,45
LU0629460089	UBS(L)FS-MSCI USA SR UCITS ETF		ANT	49.219	5.800	3.727	EUR 144,830	7.128.387,77	11,99
LU0629459743	UBS(L)FS-MSCI World Soc. Resp.		ANT	36.564	2.557	2.575	EUR 107,900	3.945.255,60	6,64
Summe Wertpapiervermögen								EUR 55.759.152,69	93,78
Derivate								EUR 100.446,32	0,17
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate								-123.006,92	-0,21
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
EURO STOXX 50 - FUTURE 16/09/2022		EU-REX	EUR	Anzahl -5				-1.600,00	0,00
EURO STOXX 50 - FUTURE 16/09/2022		EU-REX	EUR	Anzahl -4				200,00	0,00
EURO STOXX 50 - FUTURE 16/09/2022		EU-REX	EUR	Anzahl -230				118.450,00	0,20
MSCI EMERGING Markets - FUTURE 16/09/2022		ICE	USD	Anzahl -19				4.634,37	0,01
MSCI EMERGING Markets - FUTURE 16/09/2022		ICE	USD	Anzahl -28				6.829,59	0,01
MSCI EMERGING Markets - FUTURE 16/09/2022		ICE	USD	Anzahl -1				-138,70	0,00
MSCI EMERGING Markets - FUTURE 16/09/2022		ICE	USD	Anzahl -28				6.341,77	0,01
S&P 500 E-MINI FUTURE 16/09/2022		ICE	USD	Anzahl -28				-9.397,87	-0,02
S&P 500 E-MINI FUTURE 16/09/2022		ICE	USD	Anzahl -105				-248.326,08	-0,42
Devisen-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Devisen-Terminkontrakte								EUR 223.453,24	0,38
EURO FX CURR FUT (CME) 19/09/2022		EU-REX	USD	Anzahl 6				3.838,06	0,00
EURO FX CURR FUT (CME) 19/09/2022		EU-REX	USD	Anzahl 4				-1.100,00	0,00
EURO FX CURR FUT (CME) 19/09/2022		EU-REX	USD	Anzahl 2				-1.339,14	0,00
EURO FX CURR FUT (CME) 19/09/2022		EU-REX	USD	Anzahl 2				-1.351,09	0,00
EURO FX CURR FUT (CME) 19/09/2022		EU-REX	USD	Anzahl 5				388,59	0,00
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022		EU-REX	JPY	Anzahl -1				5.210,18	-0,01
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022		EU-REX	JPY	Anzahl -1				-1.496,17	-0,01
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022		EU-REX	JPY	Anzahl -1				5.210,18	-0,01
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022		EU-REX	JPY	Anzahl -1				5.210,18	-0,01
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022		EU-REX	JPY	Anzahl -1				-422,45	-0,01
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022		EU-REX	JPY	Anzahl -1				5.210,18	-0,01
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022		EU-REX	JPY	Anzahl -2				10.420,36	-0,01
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022		EU-REX	JPY	Anzahl -1				5.210,18	-0,01

YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022	EU-REX	JPY	Anzahl -9			46.891,62	-0,01	
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022	EU-REX	JPY	Anzahl -1			5.210,18	-0,01	
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022	EU-REX	JPY	Anzahl -15			78.152,70	-0,01	
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022	EU-REX	JPY	Anzahl -1			897,70	-0,01	
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022	EU-REX	JPY	Anzahl -1			5.210,18	-0,01	
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022	EU-REX	JPY	Anzahl -5			26.050,90	-0,01	
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022	EU-REX	JPY	Anzahl -3			15.630,54	-0,01	
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022	EU-REX	JPY	Anzahl -1			5.210,18	-0,01	
YEN DENOM NIKKEI 225 (CME) 08/09/2022	EU-REX	JPY	Anzahl -1			5.210,18	-0,01	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds						EUR	1.472.195,10	2,48
EUR-Guthaben bei:								
Societe Generale Paris	EUR		540.354,30	%	100,000	540.354,30	0,91	
Verwahrstelle	EUR		117.585,37	%	100,000	117.585,37	0,20	
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen								
Societe Generale Paris	JPY		1.553.641,00	%	100,000	10.938,85	0,02	
Societe Generale Paris	USD		732.269,75	%	100,000	700.434,98	1,18	
Verwahrstelle	USD		107.557,57	%	100,000	102.881,60	0,17	
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	2.224.865,82	3,74
Futures Variation Margin	EUR		-117.050,00			-117.050,00	-0,20	
Futures Variation Margin	JPY		-31.675.000,00			-223.016,81	-0,38	
Futures Variation Margin	USD		250.511,25			239.620,50	0,40	
Initial Margin	EUR		670.591,70			670.591,70	1,13	
Initial Margin	JPY		35.420.000,00			249.384,55	0,42	
Initial Margin	USD		1.469.208,40			1.405.335,88	2,36	
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-98.111,53	-0,17
Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen	EUR		-11.058,32			-11.058,32	-0,02	
Verbindlichkeiten aus Futures	EUR		-4,65			-4,65	0,00	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse I)	EUR		-1.035,45			-1.035,45	0,00	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse W)	EUR		-22,18			-22,18	0,00	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse P)	EUR		-85.990,93			-85.990,93	-0,14	
Fondsvermögen						EUR	59.458.548,40	100,00 ¹⁾
Zurechnung auf Anteilscheinklassen:								
La Française Systematic ETF Dachfonds I								
Anteiliges Fondsvermögen						EUR	1.403.080,83	
Anteilwert						EUR	17,07	
Umlaufende Anteile						STK	82.216	
La Française Systematic ETF Dachfonds W								
Anteiliges Fondsvermögen						EUR	15.023,48	
Anteilwert						EUR	12,53	
Umlaufende Anteile						STK	1.199	
La Française Systematic ETF Dachfonds P								
Anteiliges Fondsvermögen						EUR	58.040.444,09	
Anteilwert						EUR	15,21	
Umlaufende Anteile						STK	3.814.726	

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 30.06.2022

Devisenkurse (in Mengennotiz)	
Japanische Yen (JPY)	142,02965 = 1 EUR
US-Dollar (USD)	1,04545 = 1 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				
	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 MARKETS, YEN DENOM NIKKEI 225, S&P 500 E-MINI, EURO STOXX 50)				94.374
	Devisen-Derivate				
	Terminkontrakte auf Devisen				
	Gekaufte Kontrakte (Basiswert(e): EUR / USD Future)				15.566
	Verkaufte Kontrakte (Basiswert(e): EUR / USD Future)				1.748

La Française Systematic ETF Dachfonds

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR **100.446,32**
 Das durch Derivate erzielte Exposure wurde gemäß § 16 Abs. 7 DerivateV ermittelt. Dabei wurden die Marktwerte der zugrundeliegenden Basiswerte EURO STOXX 50, MSCI EMERGING, S&P 500 E-MINI, YEN DENOM NIKKEI und EUR/USD herangezogen.

Vertragspartner der derivativen Geschäfte
 Morgan Stanley

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			
International Security Identification Number (ISIN)			DE000A0MKQL5
Anteilwert	EUR		17,07
Umlaufende Anteile	STK		82.216
Anleger			Private 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		12,53
Umlaufende Anteile	STK		1.199
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		15,21
Umlaufende Anteile	STK		3.814.726
Anleger			Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%		0,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%		0,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%		1,50
Ertragsverwendung			ausschüttend
Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)			93,78
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)			0,17

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2022 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 30.06.2022 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 Gesamttrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Frankfurt am Main, August 2022

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

€ 8,0 Mio., Stand 31.12.2021

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital

€ 2,6 Mio., Stand 31.12.2021

Gesellschafter

Groupe La Française

Paris

Geschäftsführer

Berit Hamann, 20355 Hamburg

Dennis Jeske, 20144 Hamburg

Kay Scherf, 63110 Rodgau

Verwahrstelle

BNP Paribas Securities Services S.C.A.

Zweigniederlassung Frankfurt am Main

Adresse bis zum 31.01.2022:

Europa-Allee 12

60327 Frankfurt am Main

Adresse seit 01.02.2022:

Senckenberganlage 19

60325 Frankfurt am Main

Haftendes Eigenkapital: € 1.881 Mio.

Stand 31.12.2021

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

Mark Wolter

Country Head Germany La Française Gruppe

Managing Director La Française Real Estate Managers (REM)

Frankfurt

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