



LA FRANÇAISE
SYSTEMATIC ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht La Française Systematic ETF Portfolio Global

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 Portfolio Global

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		58.687.449,83	100,09
1. Investmentanteile		56.046.427,18	95,58
- Deutschland	1.634.890,05		2,79
- Frankreich	2.502.922,91		4,27
- Irland	20.656.764,88		35,23
- Luxemburg	31.251.849,34		53,30
2. Derivate		103.561,39	0,18
3. Forderungen		1.198.874,37	2,04
4. Bankguthaben		817.656,45	1,39
5. Sonstige Vermögensgegenstände		520.930,44	0,89
II. Verbindlichkeiten		-50.602,17	-0,09
III. Fondsvermögen		58.636.847,66	100,00 ¹⁾

Fußnoten:

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

La Française Systematic ETF Portfolio Global

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									
FR0010609115	LA FRANCAISE - LF Trésorerie		ANT	0	29	33	EUR 108.487,08	10.848,71	0,02
Gruppenfremde Investmentanteile									
IE00BHZPJ015	iShares MSCI EMU ESG Enhanced UCITS ETF		ANT	359.012	149.846	31.398	EUR 6,777	2.433.024,32	4,15
LU0292108619	Xtrackers MSCI EM Latin America ESG Swap UCITS ETF		ANT	6.602	460	0	EUR 39,665	261.868,33	0,45
LU1861136247	AIS-AM.IDX MSCI USA SRI PABFonds		ANT	89.046	26.208	14.538	EUR 93,702	8.343.788,29	14,23
LU1681046931	AIS-Amundi CAC 40		ANT	17.676	9.440	4.213	EUR 120,380	2.127.836,88	3,63
LU1861138961	AIS-Amundi MSCI EM SRI PABFonds		ANT	25.195	7.368	2.057	EUR 48,489	1.221.680,36	2,08
LU1437025023	AIS-MSCI UK IMI SRI PABFonds		ANT	3.507	969	138	EUR 710,600	2.492.074,20	4,25
LU1291106356	BNP Paribas Easy - MSCI Pacific ex Japan ex CWFonds		ANT	122.105	41.779	10.474	EUR 12,348	1.507.752,54	2,57
LU1753045332	BNP Paribas Easy - MSCI Europe SRI Series 5% CappedFonds		ANT	39.016	17.538	3.243	EUR 28,728	1.120.859,45	1,91
LU1753045928	BNPPE-MSCI Jap.SRI S-Ser-5%C		ANT	147.880	39.223	7.005	EUR 21,778	3.220.471,49	5,49
LU1659681669	BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C.		ANT	519.559	146.696	33.246	EUR 17,464	9.073.682,29	15,47
DE000ETFL540	Deka MSCI Germ.Ci.Ch.ESG U.ETF		ANT	135.608	68.743	16.903	EUR 12,056	1.634.890,05	2,79
IE00BHZPJ908	iShsIV-MSCI USA ESG.Enh.U.ETFShares		ANT	1.244.427	314.430	61.192	EUR 7,324	9.114.183,35	15,54
LU1900066033	MUL-Lyx.MSCI Semic.ESG Filt.U.ETF		ANT	19.238	4.202	0	EUR 28,235	543.184,93	0,93
LU2090063327	MUL-Lyx.MSCI Taiwan UCITS ETF		ANT	9.433	0	0	EUR 46,635	439.907,96	0,75
IE00BN4Q0602	UBS IRL ETF-MSCI USA CL.PA.AL.Shares		ANT	631.118	155.830	32.467	EUR 14,434	9.109.557,21	15,54
LU1953188833	UBS(L)FS-MSCI CN ESG Univ.ETF		ANT	163.578	69.574	16.646	EUR 7,921	1.295.701,34	2,21
LU2250132763	UBS(L)FS-MSCI CH IMI Soc.Resp.Fonds		ANT	166.782	50.339	5.984	EUR 12,562	2.095.115,48	3,57
Summe Wertpapiervermögen								EUR 56.046.427,18	95,58
Derivate								EUR 103.561,39	0,18
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate								EUR 81.524,16	0,14
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
EURO STOXX 50 - FUTURE 15/09/2023		EUREX	EUR	Anzahl 54				13.238,18	0,02
MSCI EMERGING Markets - FUTURE 15/09/2023		ICE	USD	Anzahl 25				-31.393,22	-0,05
S&P 500 E-MINI FUTURE 15/09/2023		ICE	USD	Anzahl 34				99.679,20	0,17
Devisen-Derivate								EUR 22.037,23	0,04
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Devisen-Terminkontrakte									
YEN DENOM NIKKEI 225 07/09/2023		EUREX	JPY	Anzahl 5				22.037,23	0,04
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR 817.656,45	1,39
EUR-Guthaben bei:									
Societe Generale Paris			EUR	203.833			% 100,000	203.832,500	0,35
Verwahrstelle			EUR	132.216,62			% 100,000	132.216,62	0,23
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle			PLN	59,57			% 100,000	13,44	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Societe Generale Paris			JPY	12.654.356,00			% 100,000	80.249,48	0,14
Societe Generale Paris			USD	352.127,57			% 100,000	322.756,71	0,55
Verwahrstelle			GBP	42.108,65			% 100,000	49.069,10	0,08
Verwahrstelle			JPY	1.490.646,00			% 100,000	9.453,15	0,02
Verwahrstelle			USD	21.891,41			% 100,000	20.065,45	0,03
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR 1.719.804,81	2,93
Forderungen aus Anteilzeichnungen			EUR	1.198.874,37				1.198.874,37	
Futures Variation Margin			EUR	-13.238,18				-13.238,18	-0,02
Futures Variation Margin			JPY	-3.475.000,00				-22.037,23	-0,04
Futures Variation Margin			USD	-74.500,00				-68.285,98	-0,12
Initial Margin			EUR	182.714,20				182.714,20	0,31
Initial Margin			JPY	3.410.000,00				21.625,02	0,04
Initial Margin			USD	458.386,50				420.152,61	0,72
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR -50.602,17	-0,09
Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen			EUR	-42,90				-42,90	0,00
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse W)			EUR	-16.880,14				-16.880,14	-0,03
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse R)			EUR	-33.679,13				-33.679,13	-0,06

Fondsvermögen			EUR	58.636.847,66	100,00 ¹⁾
Zurechnung auf Anteilscheinklassen:					
La Francaise System ETF Portfolio Global W					
Anteiliges Fondsvermögen			EUR	15.089.507,91	
Anteilwert			EUR	10,40	
Umlaufende Anteile			STK	1.450.911	
La Francaise System ETF Portfolio Global R					
Anteiliges Fondsvermögen			EUR	43.547.339,75	
Anteilwert			EUR	21,66	
Umlaufende Anteile			STK	2.010.403	

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)

Britisches Pfund	GBP	0,85815	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	JPY	157,6877	= 1 Euro (EUR)
Polnische Zloty	PLN	4,43265	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	0,97605	= 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
	Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
	Terminkontrakte				
	Aktienindex-Terminkontrakte				
	Gekaufte Kontrakte (Basiswert(e): MSCI EMERGING, YEN DENOM NIKKEI 225, S&P 500 E-MINI)				23 232
	Verkaufte Kontrakte (Basiswert(e): MSCI EMERGING, YEN DENOM NIKKEI 225, S&P 500 E-MINI)				1 078

La Française Systematic ETF Portfolio Global

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR **103.561,39**
 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 Francaise System ETF Portfolio Global W		DE000A3EEG13
International Security Identification Number (ISIN)		
Anteilwert	EUR	10,40
Umlaufende Anteile	STK	1.450.911
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		DE000A0MKQK7
International Security Identification Number (ISIN)		
Anteilwert	EUR	21,66
Umlaufende Anteile	STK	2.010.403
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	0,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,80
Ertragsverwendung		ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	95,58
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	0,18

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.

Wesentliche Änderungen

Anteilkategorie La Française Systematic ETF Portfolio Global W wurde am 01.06.2023 aufgelegt

„Mit Wirkung zum 31.05.2023, 24:00h, wurde der Fonds La Française Systematic Dynamic Allocation auf den Fonds La Française Systematic ETF Portfolio Global verschmolzen. Ausführliche Informationen zur Verschmelzung können unter folgendem Link eingesehen werden: [Bekanntmachungen - La Française Group \(la-francaise-systematic-am.com\)](https://www.la-francaise-systematic-am.com)

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