



LA FRANÇAISE

SYSTEMATIC ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht La Française Systematic Multi Asset Allocation

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 Multi Asset Allocation

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver-
I. Vermögensgegenstände		38.569.021,22	100,14
1. Aktien		8.526.172,03	22,14
- Aeronautik und Weltraum	59.130,84		0,15
- Audiovisuelle Industrie	70.194,09		0,18
- Banken	1.154.467,60		3,00
- Bau und Baustoffe	559.772,73		1,45
- Büroausstattung	150.045,60		0,39
- Chemische Industrie	142.100,72		0,37
- Einzelhandel	388.004,60		1,01
- Elektrik / Elektronik	242.554,44		0,63
- Energieversorger	242.825,14		0,63
- Holdinggesellschaften	37.177,80		0,10
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	783.671,50		2,03
- Pharmaindustrie / Biotech	1.390.352,37		3,61
- Real Estate	179.256,48		0,47
- Software	154.856,25		0,40
- Sonstige Dienstleistungen	446.812,85		1,16
- Sonstige Finanzdienstleistungen	210.396,17		0,55
- Sonstige industrielle Werte	178.203,50		0,46
- Telekommunikation	615.630,60		1,60
- Transportation	35.066,46		0,09
- Unterhaltungsindustrie	66.889,02		0,17
- Verbrauchsgüter	658.774,06		1,71
- Versicherungen	759.989,21		1,97
2. Investmentanteile		27.949.940,47	72,57
- Deutschland	5.929.979,86		15,40
- Frankreich	10.219.738,26		26,53
- Irland	11.800.222,35		30,64
3. Derivate		-64.487,38	-0,17
4. Forderungen		70.651,22	0,18
5. Bankguthaben		1.505.903,63	3,91
6. Sonstige Vermögensgegenstände		580.841,25	1,51
II. Verbindlichkeiten		-52.968,66	-0,14
III. Fondsvermögen		38.516.052,56	100,00 ¹⁾

Fußnoten:

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

La Française Systematic Multi Asset Allocation

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens	
							im Berichtszeitraum			
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE0008404005	Allianz SE	STK		128	0	32	EUR	259,500	33.216,00	0,09
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	STK		298	0	74	EUR	88,380	26.337,24	0,07
DE0005200000	Beiersdorf AG	STK		1.321	56	200	EUR	136,550	180.382,55	0,47
DE000A1DAHH0	Brenntag SE	STK		2.257	1.755	0	EUR	62,960	142.100,72	0,37
DE000CBK1001	Commerzbank AG	STK		2.545	2.944	399	EUR	14,185	36.100,83	0,09
DE0005140008	Deutsche Bank AG	STK		2.309	2.309	0	EUR	14,908	34.422,57	0,09
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK		182	182	0	EUR	191,100	34.780,20	0,09
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK		7.662	5.863	0	EUR	23,480	179.903,76	0,47
DE0006602006	GEA Group AG	STK		4.476	0	699	EUR	38,900	174.116,40	0,45
DE0008402215	Hannover Rück SE	STK		145	0	714	EUR	236,700	34.321,50	0,09
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG	STK		447	0	2.282	EUR	64,570	28.862,79	0,07
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG	STK		81	0	15	EUR	467,000	37.827,00	0,10
DE0007236101	Siemens AG	STK		407	0	923	EUR	173,720	70.704,04	0,18
							EUR	1.013.075,60	2,63	
Ausland										
GB00B1YW4409	3i Group PLC	STK		1.044	0	677	GBP	30,660	37.753,19	0,10
CH0012221716	ABB Ltd.	STK		3.974	4.428	454	CHF	49,920	205.993,54	0,53
ES0167050915	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA	STK		4.538	3.486	0	EUR	40,280	182.790,64	0,47
ES0105046009	Aena SME S.A.	STK		210	210	0	EUR	188,000	39.480,00	0,10
BE0974264930	AGEAS SA/NV	STK		874	0	151	EUR	42,680	37.302,32	0,10
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.	STK		6.245	5.048	0	EUR	27,590	172.299,55	0,45
IE00BF0L3536	AlB Group PLC	STK		11.972	11.972	0	EUR	4,936	59.093,79	0,15
NL0000235190	Airbus SE	STK		204	1.204	1.000	EUR	128,260	26.165,04	0,07
SE0000695876	Alfa Laval AB	STK		2.629	2.629	0	SEK	464,100	107.499,46	0,28
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.	STK		2.979	280	390	EUR	62,140	185.115,06	0,48
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A.	STK		1.491	0	363	EUR	23,290	34.725,39	0,09
SE0017486889	Atlas Copco AB	STK		10.689	10.689	0	SEK	199,200	187.599,01	0,49
GB00BVYFW23	Auto Trader Group PLC	STK		16.789	12.580	2.932	GBP	8,012	158.652,44	0,41
FR0000120628	AXA S.A.	STK		998	0	439	EUR	30,570	30.508,86	0,08
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent.	STK		3.218	0	1.336	EUR	9,352	30.094,74	0,08
IT0005218380	Banco BPM S.p.A.	STK		5.460	5.460	0	EUR	6,014	32.836,44	0,09
ES0113900J37	Banco Santander S.A.	STK		7.395	34.389	36.900	EUR	4,331	32.024,05	0,08
CH0531751755	Banque Cantonale Vaudoise	STK		293	293	0	CHF	95,350	29.009,45	0,08
GB00BLJXL82	Berkeley Group Holdings PLC	STK		1.375	2.252	1.698	GBP	45,880	74.405,85	0,19
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK		550	0	111	EUR	59,530	32.741,50	0,09
GB00B0744B38	Bunzl PLC	STK		4.980	3.936	0	GBP	30,100	176.797,78	0,46
FR0006174348	Bureau Veritas SA	STK		1.258	0	230	EUR	25,860	32.531,88	0,08
ES0140609019	Caixabank S.A.	STK		7.201	4.682	7.511	EUR	4,943	35.594,54	0,09
FR0000125338	Capgemini SE	STK		808	0	286	EUR	185,700	150.045,60	0,39
FR0000120172	Carrefour S.A.	STK		2.136	0	9.125	EUR	13,200	28.195,20	0,07
GB00B033F229	Centrica PLC	STK		72.974	52.606	0	GBP	1,349	116.107,72	0,30
CH0010570767	Chocoladef. Lindt & Sprüngli	STK		1	3	2	CHF	10.490,000	10.892,48	0,03
FR001400AJ45	Cie Génie Éts Michelin SCpA	STK		4.831	5.499	668	EUR	36,110	174.447,41	0,45
GB00BDCPN049	Coca-Cola Europacific Pa. PLC	STK		2.032	759	848	EUR	68,400	138.988,80	0,36
FR0000045072	Crédit Agricole S.A.	STK		2.587	2.587	0	EUR	12,740	32.958,38	0,09
FR0000120644	Danone S.A.	STK		566	566	0	EUR	57,080	32.307,28	0,08
DK0010274414	Danske Bank AS	STK		1.227	0	7.072	DKK	207,500	34.140,69	0,09
NO0010161896	DNB Bank ASA	STK		1.823	2.794	3.138	NOK	209,700	33.499,81	0,09
FR0000130452	Eiffage S.A.	STK		1.705	1.353	54	EUR	85,760	146.220,80	0,38
FI0009007884	Elisa Oyj	STK		788	0	0	EUR	42,840	33.757,92	0,09
FR0010208488	Engie S.A.	STK		2.169	2.169	0	EUR	13,335	28.923,62	0,08
IT0003132476	ENI S.p.A.	STK		6.813	6.813	0	EUR	14,354	97.793,80	0,25
AT0000652011	Erste Group Bank AG	STK		911	0	178	EUR	44,240	40.302,64	0,10
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.	STK		841	841	0	EUR	201,200	169.209,20	0,44
FR0000121121	Eurazeo SE	STK		417	417	3.248	EUR	74,350	31.003,95	0,08
NL0011585146	Ferrari N.V.	STK		87	0	38	EUR	380,700	33.120,90	0,09
GB00BN7SWP63	GSK PLC	STK		9.074	9.477	403	GBP	15,295	163.692,67	0,42
GB0005405286	HSBC Holdings PLC	STK		4.526	0	705	GBP	6,839	36.508,00	0,09
SE0000107203	Industrivärden AB	STK		1.180	0	355	SEK	357,600	37.177,80	0,10
GB00BMJ6DW54	Informa PLC	STK		3.584	0	605	GBP	8,558	36.176,06	0,09
NL0011821202	ING Groep N.V.	STK		2.164	0	686	EUR	15,962	34.541,77	0,09
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.	STK		10.302	0	4.457	EUR	3,471	35.758,24	0,09
FR0010259150	Ipsen S.A.	STK		1.596	1.308	0	EUR	114,500	182.742,00	0,47
PTJMT0AE0001	Jerónimo Martins, SGPS, S.A.	STK		4.947	4.947	0	EUR	18,250	90.282,75	0,23
BE0003565737	KBC Groep N.V.	STK		491	0	132	EUR	65,900	32.356,90	0,08
FR0000121964	Klépierre S.A.	STK		7.176	7.176	0	EUR	24,980	179.256,48	0,47
NL0000009082	Kon. KPN N.V.	STK		49.857	38.464	0	EUR	3,580	178.488,06	0,46
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX	STK		1.044	0	4.805	EUR	31,800	33.199,20	0,09
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC	STK		54.596	0	16.705	GBP	0,547	35.248,98	0,09
GB00B0SWJX34	London Stock Exchange Group PLC	STK		1.584	1.251	62	GBP	94,000	175.615,97	0,46
FR0000120321	L'Oréal S.A.	STK		89	0	0	EUR	410,050	36.494,45	0,09
GB00BKFB1C65	M&G PLC	STK		70.413	70.413	0	GBP	2,040	169.419,73	0,44
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA	STK		5.559	2.694	0	EUR	13,690	76.102,71	0,20
GB0032089863	NEXT PLC	STK		1.671	114	80	GBP	90,360	178.087,59	0,46

FI4000297767	Nordea Bank Abp	STK	15.025	15.025	0	EUR	11,115	167.002,88	0,43
FI4000297767	Nordea Bank Abp	STK	3.024	0	440	SEK	126,100	33.597,04	0,09
DK0062498333	Novo-Nordisk AS	STK	732	0	1.367	DKK	1.005,600	98.706,56	0,26
FR0000133308	Orange S.A.	STK	3.227	8.372	9.812	EUR	9,354	30.185,36	0,08
DK0060252690	Pandora A/S	STK	235	579	1.091	DKK	1.051,000	33.119,23	0,09
GB0006776081	Pearson PLC	STK	2.911	2.911	0	GBP	9,908	34.018,03	0,09
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A.	STK	2.948	0	14.171	EUR	11,895	35.066,46	0,09
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.	STK	339	0	2.050	EUR	99,380	33.689,82	0,09
IT0003828271	Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA	STK	3.446	3.446	0	EUR	48,700	167.820,20	0,44
GB00B2B0DG97	Relx PLC	STK	950	0	156	GBP	36,390	40.774,31	0,11
FR0000073272	SAFRAN	STK	167	668	501	EUR	197,400	32.965,80	0,09
GB00B8C3BL03	Sage Group PLC, The	STK	12.062	0	3.638	GBP	10,885	154.856,25	0,40
FI4000552500	Sampo OYJ	STK	4.278	4.278	0	EUR	40,100	171.547,80	0,45
FR0000121972	Schneider Electric SE	STK	163	163	0	EUR	224,300	36.560,90	0,09
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken	STK	2.634	0	574	SEK	156,500	36.319,03	0,09
FR0000121220	Sodexo S.A.	STK	2.212	1.828	0	EUR	84,000	185.808,00	0,48
NL00150001Q9	Stellantis N.V.	STK	6.891	8.177	1.286	EUR	18,470	127.276,77	0,33
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB	STK	3.549	3.549	0	SEK	100,950	31.565,78	0,08
SE0000242455	Swedbank AB	STK	1.934	0	324	SEK	218,100	37.163,47	0,10
CH0126881561	Swiss Re AG	STK	311	471	1.351	CHF	111,500	36.006,96	0,09
CH0008742519	Swisscom AG	STK	66	0	0	CHF	505,500	34.643,06	0,09
CH0244767585	UBS Group AG	STK	1.196	6.271	5.075	CHF	26,450	32.847,93	0,09
IT0005239360	UniCredit S.p.A.	STK	979	1.348	369	EUR	34,605	33.878,30	0,09
GB00B10RZP78	Unilever PLC	STK	3.834	3.022	0	GBP	43,450	196.482,04	0,51
FR0000125486	VINCI S.A.	STK	1.188	74	626	EUR	98,380	116.875,44	0,30
SE0000115446	Volvo (publ), AB	STK	1.336	0	7.773	SEK	271,100	31.910,98	0,08
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V.	STK	1.217	911	0	EUR	154,800	188.391,60	0,49
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK	352	352	412	CHF	479,100	175.113,65	0,45
						EUR		7.318.273,73	19,00
Andere Wertpapiere									
Ausland									
CH0012032048	Roche Holding AG - Genussscheine	STK	752	115	34	CHF	249,500	194.822,70	0,51
						EUR		194.822,70	0,51
Investmentanteile									
Gruppeneigene Investmentanteile									
Ausland									
FR0010609115	LA FRANCAISE - LF Trésorerie	ANT	15	29	26	EUR	112.881,030	1.648.063,04	4,28
FR0013431178	La Française Carbon Impact 2026	ANT	3.996	0	0	EUR	1.012,930	4.048.144,36	10,51
FR0010955476	La Française Obligations Europe SAI	ANT	431	0	0	EUR	9.391,020	4.043.967,51	10,50
Gruppenfremde Investmentanteile									
Ausland									
DE000ETF177	Deka Dt.B.EUROG.Ger. U.ETF	ANT	44.156	0	0	EUR	88,586	3.911.603,42	10,16
DE0005933956	iShares Core EO STOXX.50 U.E.DE	ANT	40.648	36.487	27.464	EUR	49,655	2.018.376,44	5,24
IE00BJK55C48	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF	ANT	774.067	0	0	EUR	5,237	4.053.711,47	10,52
IE00BF553838	iShs II-J.P.M.ESG \$ EM B. U.ETF	ANT	417.132	0	0	EUR	5,005	2.087.912,51	5,42
IE00BYZTVV78	iShsII-EO C.Bd 0-3yr ESG U.ETF	ANT	755.000	755.000	0	EUR	4,917	3.712.259,50	9,64
FR0000089997	OFI RS LIQUIDITES	ANT	105	0	0	EUR	4.567,270	479.563,35	1,25
IE00BD4DXB77	Xtrackers ESG USD Emerging Markets Bond Quality Weighted UC	ANT	229.348	0	0	EUR	8,486	1.946.338,87	5,05
						EUR		27.949.940,47	72,57
						EUR		36.476.112,50	94,70
Summe Wertpapiervermögen									
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
S&P 500 E-MINI FUTURE 20/09/2024		CME	USD	Anzahl 38				-67.632,38	-0,18
EURO STOXX 50 - FUTURE 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl -17				3.145,00	0,01
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle		EUR		45.857,33		%	100,000	45.857,33	0,12
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle		DKK		77.149,18		%	100,000	10.345,25	0,03
Verwahrstelle		NOK		3.250,02		%	100,000	284,80	0,00
Verwahrstelle		SEK		3.215,29		%	100,000	283,29	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Societe Generale Paris		USD		625.286,72		%	100,000	583.425,91	1,51
Verwahrstelle		AUD		1.361,86		%	100,000	848,62	0,00
Verwahrstelle		CAD		13.152,64		%	100,000	8.968,42	0,02
Verwahrstelle		CHF		435,30		%	100,000	452,00	0,00

Verwahrstelle	GBP	5.166,84	%	100,000	6.094,05	0,02	
Verwahrstelle	HKD	5.234,61	%	100,000	625,58	0,00	
Verwahrstelle	JPY	14.933.769,00	%	100,000	86.621,94	0,22	
Verwahrstelle	SGD	2.160,75	%	100,000	1.487,61	0,00	
Verwahrstelle	USD	851.368,39	%	100,000	794.372,19	2,06	
Sonstige Vermögensgegenstände					EUR	651.492,47	1,69
Dividendenforderungen Aktien	EUR	-0,01				-0,01	0,00
Dividendenforderungen Aktien	GBP	7.055,67				8.321,84	0,02
Dividendenforderungen Anteilscheine	USD	6.007,97				5.605,76	0,01
Initial Margin	EUR	56.134,60				56.134,60	0,15
Initial Margin	USD	493.240,00				460.219,27	1,19
Futures Variation Margin	EUR	-3.145,00				-3.145,00	-0,01
Futures Variation Margin	USD	72.485,00				67.632,38	0,18
Quellensteuererstattungsansprüche	EUR	19.641,30				19.641,30	0,05
Quellensteuererstattungsansprüche	CHF	31.402,99				32.607,85	0,08
Quellensteuererstattungsansprüche	DKK	18.307,58				2.454,94	0,01
Quellensteuererstattungsansprüche	GBP	930,71				1.097,73	0,00
Quellensteuererstattungsansprüche	SEK	10.462,50				921,81	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme					EUR	-33.763,36	-0,09
EUR-Kredite bei:							
Societe Generale Paris	EUR	-33.762,20	%	100,000		-33.762,20	-0,09
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen							
Societe Generale Paris	JPY	-200,00	%	100,000		-1,16	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten					EUR	-52.968,66	-0,14
Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen	EUR	-2.796,42				-2.796,42	-0,01
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse I)	EUR	-8,08				-8,08	0,00
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse W)	EUR	-41,90				-41,90	0,00
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse R)	EUR	-50.122,26				-50.122,26	-0,13
Fondsvermögen					EUR	38.516.052,56	100,00 ²⁾
Zurechnung auf Anteilscheinklassen:							
La Française Systematic Multi Asset Allocation I							
Anteiliges Fondsvermögen					EUR	10.457,60	
Anteilwert					EUR	1.045,76	
Umlaufende Anteile					STK	10	
La Française Systematic Multi Asset Allocation W							
Anteiliges Fondsvermögen					EUR	32.204,34	
Anteilwert					EUR	86,54	
Umlaufende Anteile					STK	372	
La Française Systematic Multi Asset Allocation R							
Anteiliges Fondsvermögen					EUR	38.473.390,62	
Anteilwert					EUR	126,81	
Umlaufende Anteile					STK	303.393	

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)

Australische Dollar	AUD	1,6048	= 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	GBP	0,84785	= 1 Euro (EUR)
Dänische Krone	DKK	7,45745	= 1 Euro (EUR)
Hong-Kong Dollar	HKD	8,3676	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	JPY	172,4017	= 1 Euro (EUR)
Kanadische Dollar	CAD	1,46655	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	NOK	11,4115	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	SEK	11,35	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	0,96305	= 1 Euro (EUR)
Singapur Dollar	SGD	1,4525	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar (USD)	USD	1,07175	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

Terminbörsen

EUREX	European Exchange
CME	Chicago Mercantile 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					
Aktien					
Inland					
DE000ENAG999	E.ON SE	STK	0	3.253	
Ausland					
NL0011540547	ABN AMRO Bank N.V.	STK	2.551	2.551	
ES0167050253	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA	STK	0	0	
ES0667050908	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA - Anrechte	STK	0	0	
NL0000334118	ASM International N.V.	STK	0	449	
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK	0	321	
GB0009895292	AstraZeneca PLC	STK	0	1.417	
FR0000120503	Bouygues S.A.	STK	971	971	
GB0007980591	BP PLC	STK	6.327	6.327	
GB0031743007	Burberry Group PLC	STK	0	1.563	
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG	STK	0	1.542	
GB0002374006	Diageo PLC	STK	0	5.065	
BE0974259880	D'leteren Group S.A.	STK	0	1.139	
DK0060079531	DSV Panalpina A/S	STK	0	1.013	
FR0010908533	Edenred S.A.	STK	0	3.369	
SE0015658109	Epiroc AB	STK	0	1.968	
FR001400OP17	EssilorLuxottica S.A. - Anrechte	STK	841	841	
GB00BMX86B70	Haleon PLC	STK	0	44.791	
CH0102484968	Julius Baer Gruppe AG	STK	0	640	
FR0000121485	Kering S.A.	STK	0	83	
FI0009000202	Kesko Oyj	STK	0	2.143	
FR0010307819	Legrand S.A.	STK	0	422	
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE	STK	0	49	
FI4000552526	Mandatum OYJ	STK	0	912	
IT0004965148	Moncler S.p.A.	STK	0	1.459	
GB00BM8PJY71	NatWest Group PLC	STK	0	13.572	
CH0012005267	Novartis AG	STK	0	1.848	
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.	STK	0	1.108	
NL0015001W49	Pluxee	STK	384	384	
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK	0	4.679	
NL0000379121	Randstad N.V.	STK	0	3.394	
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group	STK	0	575	
ES0173516115	Repsol S.A.	STK	1.298	13.025	
GB00B019KW72	Sainsbury PLC, J.	STK	0	61.498	
CH1243598427	Sandoz Group AG	STK	0	416	
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK	0	1.733	
GB00BP6MXD84	Shell PLC	STK	1.749	1.749	
GB00BR1W9C86	Shell PLC - Anrechte	STK	1.749	1.749	
CH0014852781	Swiss Life Holding AG	STK	0	60	
GB00BLGZ9862	Tesco PLC	STK	37.253	49.021	
FR0000121329	THALES S.A.	STK	249	249	
FR0000120271	TotalEnergies SE	STK	566	566	
NL0015000IY2	Universal Music Group N.V.	STK	0	1.426	
AT0000746409	Verbund AG	STK	403	403	
NL0015001Z20	Wolters Kluwer N.V. - Anrechte	STK	1.217	1.217	
JE00B8KF9B49	WPP PLC	STK	0	3.834	
Investmentanteile					
Gruppeneigene Investmentanteile					
FR0013289071	La Française Sub Debt FCP	ANT	0	3.824	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte					
(Basiswert(e): S&P 500 E-MINI FUTURE)					12.603
Verkaufte Kontrakte					
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 - FUTURE)					3.289

La Française Systematic Multi Asset Allocation

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR **-64.487,38**

Das durch Derivate erzielte Exposure wurde gemäß § 16 Abs. 7 DerivateV ermittelt. Dabei wurden die Marktwerte der zugrundeliegenden Basiswerte EURO STOXX 50 und S&P 500 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 Multi Asset Allocation I

International Security Identification Number (ISIN)

DE000A0MKQQ4

Anteilwert	EUR	1.045,76
Umlaufende Anteile	STK	10
Auflagedatum		19.02.2014
Mindestanlagesumme	EUR	1.000.000
Anleger		Institutionelle Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	0,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	0,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,70
Ertragsverwendung		thesaurierend

La Française Systematic Multi Asset Allocation W

International Security Identification Number (ISIN)

DE000A1W2AF2

Anteilwert	EUR	86,54
Umlaufende Anteile	STK	372
Auflagedatum		18.03.2015
Mindestanlagesumme	EUR	keine
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	0,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	1,40
Ertragsverwendung		thesaurierend

La Française Systematic Multi Asset Allocation R

International Security Identification Number (ISIN)

DE0009763235

Anteilwert	EUR	126,81
Umlaufende Anteile	STK	303.393
Auflagedatum		03.08.1970
Mindestanlagesumme	EUR	keine
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	0,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	1,40
Ertragsverwendung		ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) **94,70**

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 30.06.2024 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 Gesamttrendite-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