



LA FRANÇAISE

SYSTEMATIC ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht La Française Systematic ETF Dachfonds

vom 01.01.2021 bis 30.06.2021

La Française Systematic Asset Management GmbH

La Française Systematic Asset Management GmbH
mainBuilding
Taunusanlage 18
60325 Frankfurt am Main

Handelsregister:
Frankfurt HRB 34125

Geschäftsführung:
Berit Hamann
Dennis Jeske
Kay Scherf

www.la-francaise-systematic-am.com

Vermögensübersicht zum 30.06.2021

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		67.746.091,49	100,82
1. Investmentanteile		66.605.228,92	99,12
- Irland	6.216.905,39		9,25
- Luxemburg	60.388.323,53		89,87
2. Derivate		-439.497,44	-0,65
3. Bankguthaben		-281.970,60	-0,42
4. Sonstige Vermögensgegenstände		1.862.330,61	2,77
II. Verbindlichkeiten		-551.944,16	-0,82
III. Fondsvermögen		67.194.147,33	100,00 ¹

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

Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30/06/2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Investmentanteile									
Gruppenfremde Investmentanteile									
LU1806495575	AIS-Amun.Idx US Corp. SRI	ANT		25	0	0	EUR 52,460	1.311,50	0,00
LU1861134382	AIS-AMUNDI MSCI WORLD SRI	ANT		71.636	0	3.510	EUR 75,160	5.384.161,76	8,01
LU1859444769	BNP P.E.-EO Corp Bd.SRI Fo.Fr.	ANT		4.044	0	0	EUR 10,861	43.921,88	0,07
LU1291101555	BNP P.Easy-MSCI Eu.S.C.SRI S-S	ANT		6.137	0	0	EUR 308,109	1.890.863,09	2,81
LU2008763935	BNP PE-FTSE E/N Dv.Eur.xUK Grn	ANT		70.704	0	0	EUR 10,463	739.754,74	1,10
LU1753045415	BNPPE-MSCI Eur.SRI S-Ser.5%C.	ANT		227.517	0	0	EUR 27,311	6.213.785,04	9,25
LU1753045928	BNPPE-MSCI Jap.SRI S-Ser-5%C	ANT		136.521	0	8.670	EUR 24,021	3.279.384,59	4,88
LU1659681669	BNPPE-MSCI USA SRI S-Ser.5%C.	ANT		423.188	0	0	EUR 16,013	6.776.678,72	10,09
IE00B60SX402	InvescoMI Russell 2000 ETF	ANT		2.772	0	1.921	EUR 94,970	263.256,84	0,39
IE00B1XNHC34	iShsII-GI.Clean Energy U.ETF	ANT		115.097	125.000	9.903	EUR 11,320	1.302.898,04	1,94
IE00BYVJRR92	iShsIV-MSCI USA SRI UCITS ETF	ANT		6.631	0	271.462	EUR 10,362	68.710,42	0,10
IE00BYX2JD69	iShsIV-MSCI Wld.SRI UCITS ETF	ANT		451.472	0	20.263	EUR 8,509	3.841.575,25	5,72
IE00B3CNHJ55	L+G-L&G Ru.2000 US S.C.Q.UETF	ANT		8.887	0	0	EUR 83,320	740.464,84	1,10
LU2197908721	M.U.L.-Lyxor Nasdaq-100 UC.ETF	ANT		46.788	0	5.973	EUR 129,460	6.057.174,48	9,01
LU1769088581	MUL-Lyx.MSCI EM ESG Le.Ex.U.E.	ANT		197.712	0	23.953	EUR 20,835	4.119.329,52	6,13
LU1563454310	MUL-Lyxor Green Bond(DR)UC.ETF	ANT		51.622	0	0	EUR 54,130	2.794.298,86	4,16
LU0629460832	UBS(L)FS MSCI Pac.Soc.Resp.UE	ANT		23.902	0	1.480	EUR 70,630	1.688.198,26	2,51
LU1484799769	UBS(L)FS-BB MSCI EO A.L.C.Sus.	ANT		400.646	0	0	EUR 14,798	5.928.759,51	8,82
LU1048313891	UBS(L)FS-MSCI EM Soc.Res.U.ETF	ANT		119.719	0	15.837	EUR 14,578	1.745.263,58	2,60

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30/06/2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
LU0629460089	UBS(L)FS-MSCI USA SR UCITS ETF		ANT	60.875	0	0	EUR 153,680	9.355.270,00	13,92
LU0629459743	UBS(L)FS-MSCI World Soc. Resp.		ANT	37.480	0	17.822	EUR 116,600	4.370.168,00	6,50
Summe Wertpapiervermögen								EUR 66.605.228,92	99,12
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Devisen-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten									
								-439.497,44	-0,65
Devisen-Terminkontrakte									
EURO FX CURR FUT (CME) 13/09/2021		EUREX	USD	Anzahl 5				-150.202,38	-0,22
EURO FX CURR FUT (CME) 13/09/2021		EUREX	USD	Anzahl 8				-23.948,06	-0,04
EURO FX CURR FUT (CME) 13/09/2021		EUREX	USD	Anzahl 14				-49.435,03	-0,07
EURO FX CURR FUT (CME) 13/09/2021		EUREX	USD	Anzahl 72				-215.911,97	-0,32
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR 25.729.103,74	38,29
EUR-Guthaben bei: Verwahrstelle									
			EUR	561.273,10			% 100,000	561.273,10	0,84
Guthaben in Nicht-EU/EWR- Währungen									
Verwahrstelle			JPY	28.489.832,00			% 100,000	216.450,17	0,32
Societe Generale Paris			JPY	7.253,00			% 100,000	55,10	
Verwahrstelle			USD	29.589.776,76			% 100,000	24.951.325,37	37,13
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR 1.862.330,61	2,77
Futures Variation Margin			EUR	75.000,00				75.000,00	0,11
Futures Variation Margin			USD	220.436,87				185.881,50	0,28
Initial Margin			EUR	315.000,00				315.000,00	0,47
Initial Margin			USD	1.525.600,00				1.286.449,11	1,91

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30/06/2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme ²							EUR	-26.011.074,34	-38,71
EUR-Kredite bei:									
	Societe Generale Paris		EUR	-784.136,23			% 100,000	-784.136,23	-1,17
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	Societe Generale Paris		USD	29.916.625,91			% 100,000	-25.226.938,11	-37,54
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-551.944,16	-0,82
	Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen		EUR	-43.832,94				-43.832,94	-0,07
	Verbindlichkeiten aus Performance Fees		EUR	-410.687,30				-410.687,30	-0,61
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse I)		EUR	-1.150,28				-1.150,28	0,00
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse W)		EUR	-22,08				-22,08	0,00
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse P)		EUR	-96.251,56				-96.251,56	-0,14
Fondsvermögen							EUR	67.194.147,33	100,00 ³
Zurechnung auf Anteilscheinklassen:									
La Française Systematic ETF Dachfonds I ⁴									
	Anteiliges Fondsvermögen						EUR	1.582.262,98	
	Anteilwert						EUR	17,63	
	Umlaufende Anteile						STK	89.742	
La Française Systematic ETF Dachfonds W ⁵									
	Anteiliges Fondsvermögen						EUR	15.218,63	
	Anteilwert						EUR	12,90	
	Umlaufende Anteile						STK	1.180	

² Kurzfristige Verbindlichkeit durch Transaktionen in Derivate und Futures

³ Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

⁴ Bis 11.05.2021 Veri ETF-Dachfonds I.

⁵ Bis 11.05.2021 Veri ETF-Dachfonds W.

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30/06/2021	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
	La Française Systematic ETF Dachfonds P ⁶						EUR	65.596.665,72	
	Anteiliges Fondsvermögen						EUR	15,85	
	Anteilwert						STK	4.137.440	
	Umlaufende Anteile								

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

Japanische Yen (JPY)

US-Dollar (USD)

131,62305 = 1 EUR

1,18590 = 1 EUR

Marktschlüssel

Terminbörsen

EUREX European Exchange

⁶ Bis 11.05.2021 Veri ETF-Dachfonds P.

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
Gruppeneigene Investmentanteile					
FR0010609115	LA FRANCAISE - LF Trésorerie	ANT	4	4	
Gruppenfremde Investmentanteile					
IE00B1TXK627	iShsII-Global Water UCITS ETF	ANT	0	38.460	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Verkaufte Kontrakte					
(Basiswert(e): E-MINI MSCI EMERGING, YEN DENOM NIKKEI 225)					
					12.761
Devisen-Derivate					
Terminkontrakte auf Devisen					
Gekaufte Kontrakte					
(Basiswert(e): EUR / USD Future)					
					37.650

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR -439.497,44
Das durch Derivate erzielte Exposure wurde gemäß § 16 Abs. 7 DerivateV ermittelt. Dabei wurde der Marktwert des zugrundeliegenden Basiswertes Eur/USD herangezogen.

Vertragspartner der derivativen Geschäfte
Societe Generale Paris

Sonstige Angaben

La Française Systematic ETF Dachfonds I⁷
International Security Identification Number (ISIN) DE000A0MKQL5

	EUR	
Anteilwert	17,63	
Umlaufende Anteile	89.742	
Anleger		Private Anleger
Mindestanlagesumme		100.000 EUR
Fondsauflage		16.04.2008
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	0,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	0,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,60
Ertragsverwendung		ausschüttend

La Française Systematic ETF Dachfonds W⁸
International Security Identification Number (ISIN) DE000A0MKQH3

	EUR	
Anteilwert	12,90	
Umlaufende Anteile	1.180	
Anleger		Private Anleger
Mindestanlagesumme		keine
Fondsauflage		02.09.2013
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	0,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	1,50
Ertragsverwendung		ausschüttend

⁷ Bis 11.05.2021 Veri ETF-Dachfonds I.

⁸ Bis 11.05.2021 Veri ETF-Dachfonds W.

La Française Systematic ETF Dachfonds P ⁹

International Security Identification Number (ISIN)

Anteilwert**Umlaufende Anteile**

Anleger

Mindestanlagesumme

Fondsaufgabe

Aktueller Ausgabeaufschlag

Aktueller Rücknahmeabschlag

Verwaltungsvergütung p. a.

Ertragsverwendung

EUR

STK

DE0005561674

15,85**4.137.440**

Private Anleger

keine

02.04.2007

%

0,00

%

0,00

%

1,50

ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)**99,12****Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)****-0,65****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.

Wesentliche Änderungen

Die Namenänderungen erfolgten mit Genehmigung der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht vom 07.04.2021 und wurden im Bundesanzeiger am 18. Mai 2021 veröffentlicht. Der Hintergrund der Änderung ist die Umfirmierung des Unternehmens, die Namensänderung der OGAW-Sondervermögen, sowie gesetzliche Änderungen. Die Gesellschaft firmiert zukünftig unter dem Namen La Française Systematic Asset Management GmbH (vormals La Française Asset Management GmbH). Die Änderungen traten am 12.05.2021 in Kraft.

⁹ Bis 11.05.2021 Veri ETF-Dachfonds P.

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die von der Verwahrstelle übermittelten Bewertungskurse für die einzelnen Wertpapiere bzw. Derivate werden von der La Française Asset Management GmbH als verantwortliche Stelle für die Anteilpreisermittlung mittels unabhängiger Referenzkurse von Informationsdienstleistern wie Bloomberg, Reuters oder Interactive Data stichprobenartig geprüft.

Im Fall von handelbaren Wertpapieren erfolgt die Bewertung zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs. Wertpapiere, für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden im Rahmen eines mehrstufigen Prozesses einer detaillierten Kursprüfung unterzogen, wobei folgende Grundsätze gelten:

- Wertpapiere, für die in Bloomberg kein Kurs bereitgestellt wird, oder deren Kurs länger als 10 Bewertungstage konstant ist, werden als nicht mehr handelbar eingestuft. Die von der Verwahrstelle für diese Wertpapiere gelieferten Kurse werden mittels Quotierungen Dritter oder anhand von Preisen auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen plausibilisiert.
- Ein Wechsel der Kursquelle erfolgt nur bei dauerhafter Verfügbarkeit der neuen Quelle.
- Steht als Kursquelle ausschließlich ein mittels Bewertungsmodell errechneter Preis zur Verfügung, wird dieser Preis anhand eines weiteren unabhängigen Bewertungsmodells verifiziert (Einhaltung des Zwei-Quellen-Prinzips).

Die Bewertung von Investmentanteilen erfolgt grundsätzlich auf Basis des Rücknahmepreises des Vortages oder - sofern kein Rücknahmepreis verfügbar ist - auf Basis von Börsenkursen. Exchange-Traded-Funds werden zum Börsenkurs bewertet.

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Nicht börsengehandelte Derivate (wie z.B. Devisentermingeschäfte oder Swaps) werden mittels marktgängiger Verfahren unter Einbeziehung der relevanten Marktinformationen bewertet.

Bankguthaben und sonstige Vermögensgegenstände sind zum Nennwert bewertet. Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

Frankfurt am Main, August 2021

La Française Systematic Asset Management GmbH

Die Geschäftsführung

ANGABEN ZUR GESELLSCHAFT

La Française Systematic Asset Management GmbH

[seit 12.05.2021]

(vormals La Française Asset Management GmbH)

mainBuilding

Taunusanlage 18

60325 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

€ 2,5 Mio., Stand 31.12.2020

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital

€ 2,6 Mio., Stand 31.12.2020

Gesellschafter

Groupe La Française

Paris

Geschäftsführer

Kay Scherf, 63110 Rodgau

Berit Hamann, 20355 Hamburg (seit 12.05.2021)

Dennis Jeske, 20144 Hamburg (seit 12.05.2021)

Hosnia Said, 61381 Friedrichsdorf (bis zum 23.02.2021)

Pascal Traccucci, 92100 Boulogne, Frankreich

(bis zum 12.05.2021)

Jens Göttler, 64683 Einhausen (bis zum 12.05.2021)

Verwahrstelle

BNP Paribas Securities Services S.C.A.

Zweigniederlassung Frankfurt am Main

Europa-Allee 12

60327 Frankfurt am Main

Haftendes Eigenkapital: € 106 Mrd.

Stand 31.12.2020

(seit 01.03.2021)

Zweigstelle Frankfurt am Main der

Société Générale S.A., Paris

Neue Mainzer Straße 46-50

60311 Frankfurt am Main

Haftendes Eigenkapital: € 66,7 Mrd.,

Stand 31.12.2020

(bis zum 28.02.2021)

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

Laurent Jacquier-Laforge

Global Head of Sustainable Investing

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

mainBuilding

Taunusanlage 18

60325 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