



LA FRANÇAISE
SYSTEMATIC ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht La Française Systematic Multi Asset Allocation

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 Multi Asset Allocation

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		44.924.776,35	100,14
1. Aktien		9.959.672,21	22,20
- Audiovisuelle Industrie	418.043,97		0,93
- Banken	1.113.632,17		2,48
- Bau und Baustoffe	411.850,80		0,92
- Büroausstattung	209.474,85		0,47
- Einzelhandel	185.871,18		0,41
- Elektrik / Elektronik	444.537,45		0,99
- Energieversorger	604.016,47		1,35
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	420.020,69		0,94
- Pharmaindustrie / Biotech	1.484.681,23		3,31
- Real Estate	212.969,67		0,47
- Software	46.813,86		0,10
- Sonstige Dienstleistungen	615.692,17		1,37
- Sonstige Finanzdienstleistungen	250.412,63		0,56
- Telekommunikation	942.828,75		2,10
- Textilien und Kleidung	384.077,65		0,86
- Unterhaltungsindustrie	265.991,40		0,59
- Verbrauchsgüter	1.184.432,11		2,64
- Versicherungen	764.325,16		1,70
2. Investmentanteile		32.135.065,96	71,63
- Deutschland	6.760.502,50		15,07
- Frankreich	16.354.021,53		36,45
- Irland	9.020.541,93		20,11
3. Derivate		185.957,43	0,41
4. Forderungen		76.215,82	0,17
5. Bankguthaben		2.032.354,30	4,53
6. Sonstige Vermögensgegenstände		535.510,63	1,19
II. Verbindlichkeiten		-62.480,44	-0,14
III. Fondsvermögen		44.862.295,91	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 2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
							im Berichtszeitraum		
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE0008404005	Allianz SE		STK	188	188	0	EUR 213,200	40.081,60	0,09
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	399	0	3.088	EUR 112,520	44.895,48	0,10
DE0005200000	Beiersdorf AG		STK	1.653	1.653	0	EUR 121,250	200.426,25	0,45
DE0005810055	Deutsche Börse AG		STK	239	0	98	EUR 169,100	40.414,90	0,09
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	8.954	0	5.250	EUR 19,976	178.865,10	0,40
DE0006602006	GEA Group AG		STK	922	4.825	3.903	EUR 38,310	35.321,82	0,08
DE0008402215	Hannover Rück SE		STK	222	0	854	EUR 194,350	43.145,70	0,10
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG		STK	2.781	2.781	0	EUR 73,670	204.876,27	0,46
DE0006599905	Merck KGaA		STK	1.158	170	540	EUR 151,550	175.494,90	0,39
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	602	0	408	EUR 343,600	206.847,20	0,46
							EUR	1.170.369,22	2,61
Ausland									
GB00B1YW4409	3i Group PLC		STK	2.087	2.403	316	GBP 19,485	47.387,05	0,11
CH0012221716	ABB Ltd.		STK	6.505	6.505	0	CHF 35,180	234.461,25	0,52
NL0011540547	ABN AMRO Bank N.V.		STK	2.705	2.705	0	EUR 14,230	38.492,15	0,09
ES0125220311	Acciona S.A.		STK	1.104	1.104	0	EUR 155,400	171.561,60	0,38
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.		STK	6.353	0	2.471	EUR 31,260	198.594,78	0,44
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V.		STK	3.283	3.283	0	EUR 51,830	170.157,89	0,38
NL0010273215	ASML Holding N.V.		STK	65	155	90	EUR 663,000	43.095,00	0,10
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A.		STK	2.241	2.241	0	EUR 18,620	41.727,42	0,09
GB0009895292	AstraZeneca PLC		STK	1.543	1.543	0	GBP 112,760	202.748,56	0,45
GB00BVYVFW23	Auto Trader Group PLC		STK	29.291	0	12.490	GBP 6,104	208.346,16	0,46
FR0000120628	AXA S.A.		STK	7.071	0	3.780	EUR 27,025	191.093,78	0,43
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent.		STK	6.133	6.133	0	EUR 7,032	43.127,26	0,10
ES0113900J37	Banco Santander S.A.		STK	11.679	63.543	51.864	EUR 3,385	39.533,42	0,09
CH0531751755	Banque Cantonale Vaudoise		STK	437	437	0	CHF 94,500	42.309,82	0,09
FR0000131104	BNP Paribas S.A.		STK	661	661	0	EUR 57,720	38.152,92	0,09
GB00B0744B38	Bunzl PLC		STK	1.164	0	6.807	GBP 29,990	40.678,62	0,09
GB0031743007	Burberry Group PLC		STK	7.049	0	4.838	GBP 21,200	174.140,65	0,39
FR0006174348	Bureau Veritas SA		STK	1.488	1.488	0	EUR 25,120	37.378,56	0,08
ES0140609019	Caixabank S.A.		STK	10.030	10.030	0	EUR 3,787	37.983,61	0,08
FR0000125338	Capgemini SE		STK	1.207	0	294	EUR 173,550	209.474,85	0,47
FR0000120172	Carrefour S.A.		STK	2.301	2.301	0	EUR 17,355	39.933,86	0,09
GB00BDCPN049	Coca-Cola Europacific Pa. PLC		STK	3.722	3.722	0	EUR 59,000	219.598,00	0,49
GB00BD6K4575	Compass Group PLC		STK	8.579	8.579	0	GBP 22,020	220.135,85	0,49
FR0000045072	Crédit Agricole S.A.		STK	3.693	3.693	0	EUR 10,872	40.150,30	0,09
DK0010274414	Danske Bank AS		STK	1.993	1.993	0	DKK 166,000	44.431,94	0,10
IE0002424939	DCC PLC		STK	3.954	0	385	GBP 43,980	202.641,64	0,45
GB0002374006	Diageo PLC		STK	934	934	0	GBP 33,790	36.776,62	0,08
NO0010161896	DNB Bank ASA		STK	2.167	0	3.975	NOK 200,700	37.208,96	0,08
FR0010908533	Edenred S.A.		STK	3.661	3.661	0	EUR 61,340	224.565,74	0,50
FR0000130452	Eiffage S.A.		STK	406	0	479	EUR 95,580	38.805,48	0,09
FI0009007884	Elisa Oyj		STK	2.853	3.758	905	EUR 48,940	139.625,82	0,31
FR0000121121	Eurazeo SE		STK	625	0	249	EUR 64,450	40.281,25	0,09
NL0006294274	Euronext N.V.		STK	2.047	0	1.820	EUR 62,300	127.528,10	0,28
GB00B19NLV48	Experian PLC		STK	6.696	6.696	0	GBP 30,180	235.489,46	0,52
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA		STK	2.647	2.647	0	NOK 171,800	38.906,16	0,09
NL0000009165	Heineken N.V.		STK	402	402	0	EUR 94,180	37.860,36	0,08
GB0005405286	HSBC Holdings PLC		STK	6.284	29.895	23.611	GBP 6,217	45.525,41	0,10
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA		STK	1.893	1.893	0	EUR 35,460	67.125,78	0,15
GB00BMJ6DW54	Informa PLC		STK	25.817	25.817	0	GBP 7,260	218.413,35	0,49
NL0011821202	ING Groep N.V.		STK	18.214	18.214	0	EUR 12,338	224.724,33	0,50
FR0010259150	Ipsen S.A.		STK	1.922	1.552	195	EUR 110,200	211.804,40	0,47
CH0102484968	Julius Baer Gruppe AG		STK	640	640	0	CHF 56,340	36.942,37	0,08
BE0003565737	KBC Groep N.V.		STK	623	623	0	EUR 63,920	39.822,16	0,09
FR0000121485	Kering S.A.		STK	335	335	0	EUR 505,600	169.376,00	0,38
FI0009000202	Kesko Oyj		STK	10.192	10.192	0	EUR 17,250	175.812,00	0,39
NL0000009082	Kon. KPN N.V.		STK	12.049	0	67.367	EUR 3,269	39.388,18	0,09
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX		STK	5.236	5.236	0	EUR 36,040	188.705,44	0,42
FR0010307819	Legrand S.A.		STK	1.839	1.839	0	EUR 90,800	166.981,20	0,37
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC		STK	71.301	71.301	0	GBP 0,436	36.217,57	0,08
GB00BOSWJX34	London Stock Exchange Group PLC		STK	467	467	0	GBP 83,660	45.527,26	0,10
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE		STK	47	0	368	EUR 863,000	40.561,00	0,09
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA		STK	4.130	4.130	0	EUR 10,960	45.264,80	0,10
FI0009014575	Metso Outotec Oyj		STK	4.119	4.119	0	EUR 11,045	45.494,36	0,10
FI0009013296	Neste Oyj		STK	3.539	3.539	0	EUR 35,260	124.785,14	0,28
NL0010773842	NN Group N.V.		STK	1.194	1.194	0	EUR 33,910	40.488,54	0,09
FI4000297767	Nordea Bank Abp		STK	4.154	4.154	0	SEK 117,300	41.348,77	0,09
CH0012005267	Novartis AG		STK	527	0	1.813	CHF 90,000	48.593,82	0,11
DK00060534915	Novo-Nordisk AS		STK	273	0	2.092	DKK 1.099,400	40.308,65	0,09
FR0000133308	Orange S.A.		STK	17.568	17.568	0	EUR 10,702	188.012,74	0,42
FR0000120321	Oréal S.A., L'		STK	131	0	643	EUR 427,100	55.950,10	0,12
FI0009014377	Orion Corp.		STK	969	969	0	EUR 38,020	36.841,38	0,08
DK00060252690	Pandora A/S		STK	470	470	0	DKK 609,200	38.453,66	0,09

GB0006776081	Pearson PLC	STK	20.841	20.841	0	GBP	8,220	199.630,62	0,44
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.	STK	204	204	0	EUR	202,400	41.289,60	0,09
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.	STK	551	0	4.251	EUR	73,500	40.498,50	0,09
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK	4.662	4.662	0	EUR	41,140	191.794,68	0,43
NL0000379121	Randstad N.V.	STK	1.602	921	5.185	EUR	48,310	77.392,62	0,17
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group	STK	575	575	0	GBP	59,120	39.613,12	0,09
GB00B2B0DG97	Relx PLC	STK	1.338	0	8.780	GBP	26,210	40.865,79	0,09
ES0173516115	Repsol S.A.	STK	2.754	2.754	0	EUR	13,330	36.710,82	0,08
GB00B8C3BL03	Sage Group PLC, The	STK	4.344	4.344	0	GBP	9,248	46.813,86	0,10
FI0009003305	Sampo OYJ	STK	912	0	2.514	EUR	41,120	37.501,44	0,08
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK	390	0	2.779	EUR	98,200	38.298,00	0,09
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken	STK	15.599	15.599	0	SEK	119,150	157.720,76	0,35
IT0003153415	Snam S.p.A.	STK	7.992	7.992	0	EUR	4,787	38.257,70	0,09
FR0000121220	Sodexo S.A.	STK	439	439	0	EUR	100,850	44.273,15	0,10
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB	STK	5.101	5.101	0	SEK	90,340	39.105,11	0,09
SE0000242455	Swedbank AB	STK	2.258	2.258	0	SEK	181,850	34.844,58	0,08
SE0000872095	Swedish Orphan Biovitrum AB	STK	1.813	9.668	7.855	SEK	210,400	32.369,92	0,07
CH0014852781	Swiss Life Holding AG	STK	86	86	0	CHF	523,000	46.081,66	0,10
CH0008038389	Swiss Prime Site AG	STK	2.677	2.677	0	CHF	77,650	212.969,67	0,47
CH0126881561	Swiss Re AG	STK	421	421	0	CHF	90,040	38.836,99	0,09
CH0008742519	Swisscom AG	STK	330	330	0	CHF	557,800	188.590,75	0,42
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA	STK	25.829	25.829	0	EUR	7,806	201.621,17	0,45
GB00B10RZP78	Unilever PLC	STK	812	812	0	GBP	40,975	38.771,43	0,09
FR0000125486	VINCI S.A.	STK	1.894	1.894	0	EUR	106,380	201.483,72	0,45
SE0000115446	Volvo (publ), AB	STK	4.726	11.009	6.283	SEK	223,000	89.432,76	0,20
JE00B8KF9B49	WPP PLC	STK	3.834	3.834	0	GBP	8,234	36.787,46	0,08
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK	91	0	235	CHF	424,900	39.614,67	0,09
						EUR		8.578.023,85	19,12
Andere Wertpapiere									
Ausland									
CH0012032048	Roche Holding AG - Genussscheine	STK	754	100	96	CHF	273,500	211.279,14	0,47
						EUR		211.279,14	0,47
Investmentanteile									
Gruppeneigene Investmentanteile									
Ausland									
FR0013431178	La Française Carbon Impact 2026Fonds	ANT	4.678	4.634	268	EUR	966,390	4.521.226,62	10,08
FR0010955476	La Française Obligations Europe SAI-Fonds	ANT	506	496	24	EUR	8.799,72	4.449.320,50	9,92
FR0013289071	La Française Sub Debt FCFPonds	ANT	4.697	4.399	0	EUR	976,150	4.584.507,75	10,22
FR0010609115	LA FRANCAISE - LF Trésorerie	ANT	26	83	137	EUR	108.487,08	2.798.966,66	6,24
Gruppenfremde Investmentanteile									
Ausland									
DE0005933956	iShares Core EO STOXX.50 U.E.DE	ANT	52.050	93.846	41.796	EUR	44,660	2.324.553,00	5,18
IE00BD4DXB77	Xtrackers ESG USD Emerging Markets Bond Quality Weighted UCFonds	ANT	252.846	236.686	9.247	EUR	8,830	2.232.529,04	4,98
IE00BF553838	iShs II-J.P.M.ESG \$ EM B.U.ETF	ANT	490.674	502.688	28.906	EUR	4,592	2.253.224,08	5,02
IE00BJK55C48	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF	ANT	940.769	1.867.710	989.928	EUR	4,820	4.534.788,81	10,11
DE000ETFL177	Deka Dt.B.EUROG.Ger. U.ETF	ANT	51.056	50.497	2.801	EUR	86,884	4.435.949,50	9,89
						EUR		32.135.065,96	71,63
						EUR		42.094.738,17	93,83
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 15/09/2023		CME	USD	Anzahl 1				3.998,63	0,01
S&P 500 E-MINI FUTURE 15/09/2023		CME	USD	Anzahl 57				186.908,80	0,42
EURO STOXX 50 - FUTURE 15/09/2023		EUREX	EUR	Anzahl -22				-4.950,00	-0,01
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Societe Generale Paris		EUR		203.369,43		%	100,000	203.369,43	0,45
Verwahrstelle		EUR		13.276,80		%	100,000	13.276,80	0,03
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle		DKK		77.043,42		%	100,000	10.347,02	0,02
Verwahrstelle		NOK		3.250,00		%	100,000	278,05	0,00
Verwahrstelle		SEK		3.215,29		%	100,000	272,85	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Societe Generale Paris		USD		1.039.790,83		%	100,000	953.062,17	2,12
Verwahrstelle		AUD		1.361,86		%	100,000	830,91	0,00
Verwahrstelle		CAD		13.152,60		%	100,000	9.110,34	0,02
Verwahrstelle		CHF		435,30		%	100,000	445,98	0,00
Verwahrstelle		GBP		5.166,84		%	100,000	6.020,91	0,01

Verwahrstelle	HKD	5.234,59	%	100,000	612,25	0,00	
Verwahrstelle	JPY	14.933.769,00	%	100,000	94.704,72	0,21	
Verwahrstelle	SGD	2.160,75	%	100,000	1.463,43	0,00	
Verwahrstelle	USD	805.768,38	%	100,000	738.559,47	1,65	
Sonstige Vermögensgegenstände					EUR	611.726,45	1,36
Dividendenforderungen Aktien	EUR	-0,01				-0,01	
Dividendenforderungen Aktien	GBP	13.292,36				15.489,55	0,00
Dividendenforderungen Aktien	USD	2.527,74				2.316,90	0,03
Dividendenforderungen Anteilscheine	USD	6.007,97				5.506,85	0,01
Initial Margin	EUR	66.509,30				66.509,30	
Initial Margin	USD	714.560,00				654.958,75	1,46
Futures Variation Margin	EUR	4.950,00				4.950,00	
Futures Variation Margin	USD	-208.280,00				-190.907,42	-0,43
Quellensteuererstattungsansprüche	CHF	25.481,23				26.106,48	0,06
Quellensteuererstattungsansprüche	DKK	24.994,53				3.356,80	0,01
Quellensteuererstattungsansprüche	EUR	21.466,86				21.466,86	0,05
Quellensteuererstattungsansprüche	GBP	930,71				1.084,55	0,00
Quellensteuererstattungsansprüche	SEK	10.462,50				887,84	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme					EUR	0,00	0,00
EUR-Kredite bei:							
Societe Generale Paris	JPY	-4,00	%	100,000		-0,03	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten					EUR	-62.480,44	-0,14
Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen	EUR	-117,06				-117,06	0,00
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse I)	EUR	-7,88				-7,88	0,00
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (KlasseW)	EUR	-40,81				-40,81	0,00
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse R)	EUR	-62.314,69				-62.314,69	-0,14
Fondsvermögen					EUR	44.862.295,91	100,00¹⁾
Zurechnung auf Anteilscheinklassen:							
La Française Systematic Multi Asset Allocation I							
Anteiliges Fondsvermögen					EUR	9.644,87	
Anteilwert					EUR	964,49	
Umlaufende Anteile					STK	10	
La Française Systematic Multi Asset Allocation W							
Anteiliges Fondsvermögen					EUR	29.378,86	
Anteilwert					EUR	80,37	
Umlaufende Anteile					STK	366	
La Française Systematic Multi Asset Allocation R							
Anteiliges Fondsvermögen					EUR	44.823.272,18	
Anteilwert					EUR	117,77	
Umlaufende Anteile					STK	380.605	

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)

Australische Dollar	AUD	1,639	= 1 Euro (EUR)
Britische Pfund	GBP	0,85815	= 1 Euro (EUR)
Dänische Krone	DKK	7,44595	= 1 Euro (EUR)
Hong-Kong Dollar	HKD	8,5497	= 1 Euro (EUR)
Japanische Yen	JPY	157,6877	= 1 Euro (EUR)
Kanadische Dollar	CAD	1,4437	= 1 Euro (EUR)
Norwegische Krone	NOK	11,6885	= 1 Euro (EUR)
Schwedische Krone	SEK	11,78425	= 1 Euro (EUR)
Schweizer Franken	CHF	0,97605	= 1 Euro (EUR)
Singapur Dollar	SGD	1,4765	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar (USD)	USD	1,091	= 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					
DE0005909006	Bilfinger SE	STK	0	1.936	
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG	STK	0	1.053	
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK	0	2.579	
DE0006335003	KRONES AG	STK	0	537	
Ausland					
SE0011337708	AAK AB	STK	0	3.776	
NL0015001B69	ABN AMRO Bank N.V. - Anrechte	STK	2.705	2.705	
ES0132105018	Acerinox SA (CE Fab.Acero In.)	STK	0	6.175	
NO0010345853	Aker BP ASA	STK	5.719	5.719	
NO0010716582	Aker Solutions ASA	STK	0	20.640	
NL0012817175	Alfen N.V.	STK	0	529	
NL0006237562	Arcadis N.V.	STK	0	5.570	
NL0011872643	ASR Nederland N.V.	STK	0	4.876	
AT0000969985	AT&S Austria Techn.&Systemt.AG	STK	0	1.499	
IT0001137345	Autogrill S.p.A.	STK	0	7.940	
GB0000961622	Balfour Beatty PLC	STK	0	14.318	
BE0974362940	Barco N.V.	STK	0	2.414	
AT0000BAWAG2	BAWAG Group AG	STK	0	1.380	
GB00BYQ0JC66	Beazley PLC	STK	0	9.973	
IT0005244402	BFF Bank S.p.A.	STK	0	7.340	
SE0000862997	BillerudKorsnäs AB	STK	0	4.115	
FR0013280286	bioMerieux	STK	1.952	1.952	
CH0238627142	Bossard Holding AG	STK	0	294	
IT0005252728	Brembo S.p.A.	STK	0	5.562	
CH0002432174	Bucher Industries AG	STK	0	148	
CH0225173167	Cembra Money Bank AG	STK	0	687	
FR0000130403	Christian Dior SE	STK	0	84	
DK0060448595	Coloplast AS	STK	342	342	
NL0010583399	Corbion N.V.	STK	0	2.037	
GB0002318888	Cranswick PLC	STK	0	3.716	
BE0974259880	D'leteren Group S.A.	STK	0	332	
CH0126673539	DKSH Holding AG	STK	0	3.191	
GB00B1VNSX38	Drax Group PLC	STK	0	8.402	
NO0010816093	Elkem ASA	STK	0	14.371	
GB00BG12Y042	Energiean PLC	STK	0	3.132	
DK0010234467	FLSmith & Co. AS	STK	0	2.216	
CH0360674466	Galenica AG	STK	0	3.376	
GB00BN7SWP63	GSK PLC	STK	0	16.367	
GB0004161021	Hays PLC	STK	0	43.548	
SE0007074281	Hexpol AB	STK	0	5.831	
SE0011090018	Holmen AB	STK	0	6.525	
GB00B06QFB75	IG Group Holdings PLC	STK	0	5.738	
GB00BN4HT335	Indivior PLC	STK	0	3.204	
FR0000073298	IPSOS S.A.	STK	0	1.068	
DK0060542181	ISS AS	STK	0	3.185	
IT0005211237	Italgas S.P.A.	STK	0	9.857	
PTJMT0AE0001	Jerónimo Martins, SGPS, S.A.	STK	0	13.076	
GB0005603997	Legal & General Group PLC	STK	13.739	13.739	

CH0025751329	Logitech International S.A.	STK	615	615
GB00BYQ46T41	LXI REIT PLC	STK	0	36.664
JE00BJ1DLW90	Man Group Ltd.	STK	0	91.810
FI0009000665	Metsä Board Oyj	STK	0	6.460
GB00BDR05C01	National Grid PLC	STK	3.327	3.327
CH0038863350	Nestlé S.A.	STK	1.705	1.705
NL0015001EI2	NN Group N.V. - Anrechte	STK	1.194	1.194
NL0010558797	OCI N.V.	STK	0	1.169
NO0003733800	Orkla ASA	STK	0	33.758
FI0009002422	Outokumpu Oyj	STK	0	13.720
GB00B2NGPM57	Paragon Banking Group PLC	STK	0	10.770
PTRELOAM0008	REN-Redes Energ.Nacionais SGPS	STK	0	20.886
FR0010451203	Rexel S.A.	STK	0	15.370
GB00BGDT3G23	Rightmove PLC	STK	0	9.485
GB0003096442	RS Group PLC	STK	0	6.690
GB00B1N7Z094	Safestore Holdings PLC	STK	0	5.212
IT0004729759	Sesa S.p.A.	STK	0	461
CH0239229302	SFS Group AG	STK	0	572
CH0014284498	Siegfried Holding AG	STK	0	77
FR0000120966	Société Bic S.A.	STK	0	793
FR0000050809	Sopra Steria Group S.A.	STK	0	363
NO0010631567	Sparebank 1 SR-Bank ASA	STK	0	5.234
FR0012757854	Spie S.A.	STK	0	11.313
GB0004726096	Spirent Communications PLC	STK	0	17.242
SE0000171100	SSAB AB	STK	0	10.261
NL0000226223	STMicroelectronics N.V.	STK	0	7.519
NO0003078800	TGS Nopec Geophysical Co. ASA	STK	0	3.523
BE0003739530	UCB S.A.	STK	496	496
ES0184262212	Viscofan S.A.	STK	0	870
BE0974349814	Warehouses De Pauw N.V.	STK	0	6.069
AT0000831706	Wienerberger AG	STK	0	2.385
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V.	STK	0	2.502
NO0010208051	Yara International ASA	STK	0	6.333
Gruppenfremde Investmentanteile				
FR0000008997	OFI RS LIQUIDITESFonds	ANT	0	1.975
FR0000989626	Groupama Cash FCPFonds	ANT	0	142

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)

24.309

Verkaufte Kontrakte

(Basiswert(e): EURO STOXX 50 - FUTURE)

6.255

La Française Systematic Multi Asset Allocation

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR **185.957,43**

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

Vertragspartner der derivativen Geschäfte

Societe Generale Paris

Sonstige Angaben

La Française Systematic Multi Asset Allocation I International Security Identification Number (ISIN)

Anteilwert	EUR	DE000A0MKQQ4	964,49
Umlaufende Anteile	STK		10
Anleger		Private 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)

Anteilwert	EUR	DE000A1W2AF2	80,37
Umlaufende Anteile	STK		366
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)

Anteilwert	EUR	DE0009763235	117,77
Umlaufende Anteile	STK		380.605
Anleger		Private Anleger	
Aktueller Ausgabeaufschlag	%		5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%		0,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%		1,40
Ertragsverwendung		ausschüttend	

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) **93,83**

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) **0,41**

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.

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

€ 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