



LA FRANÇAISE

SYSTEMATIC ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht La Française Systematic Multi Asset Allocation

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		53.722.894,26	100,72
1. Aktien		13.084.935,51	24,53
- Deutschland	367.675,30		0,69
- Finnland	1.084.028,86		2,03
- Frankreich	3.265.522,65		6,12
- Großbritannien	1.464.598,23		2,75
- Irland	352.894,66		0,66
- Italien	1.404.093,60		2,63
- Niederlande	1.095.706,44		2,05
- Schweden	1.111.976,67		2,08
- Schweiz	2.938.439,10		5,51
2. Investmentanteile		39.949.797,37	74,90
- Deutschland	6.669.850,12		12,50
- Frankreich	22.445.517,85		42,08
- Irland	10.834.429,40		20,31
3. Derivate		-111.125,00	-0,21
4. Forderungen		77.717,08	0,15
5. Bankguthaben		167.052,88	0,31
6. Sonstige Vermögensgegenstände		554.516,42	1,04
II. Verbindlichkeiten		-384.187,76	-0,72
III. Fondsvermögen		53.338.706,50	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										
Aktien										
Inland										
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	20.642	24.250	3.608	EUR EUR	17,812 367.675,30 367.675,30	0,69 0,69	
Ausland										
IT0001233417	A2A S.p.A.		STK	205.525	205.525	0	EUR	1,724	354.325,10	0,66
IT0001207098	ACEA S.p.A.		STK	17.447	17.447	12.600	EUR	19,490	340.042,03	0,64
SE0006993770	Axfood AB		STK	16.101	18.600	2.499	SEK	236,700	375.774,67	0,70
GB00BV9FP302	Computacenter PLC		STK	11.810	14.000	2.190	GBP	25,720	353.839,13	0,66
IE0002424939	DCC PLC		STK	5.119	5.613	494	GBP	59,180	352.894,66	0,66
CH0126673539	DKSH Holding AG		STK	5.624	6.248	624	CHF	70,800	363.235,91	0,68
GB0003096442	Electrocomponents PLC		STK	30.996	34.327	3.331	GBP	10,290	371.540,38	0,70
FI0009007884	Elisa Oyj		STK	7.157	8.945	1.788	EUR	50,320	360.140,24	0,68
CH0360674466	Galenica AG		STK	6.150	7.259	1.109	CHF	65,300	366.351,94	0,69
FR0011726835	Gaztransport Technigaz		STK	4.990	10.138	5.148	EUR	68,100	339.819,00	0,64
CH0030170408	Geberit AG		STK	594	594	405	CHF	694,000	376.059,11	0,71
SE0000202624	Getinge AB		STK	12.168	12.168	0	SEK	322,800	387.283,61	0,73
CH0010645932	Givaudan SA		STK	93	204	111	CHF	4.303,000	365.060,21	0,68
FR0000052292	Hermes International S.C.A.		STK	304	440	136	EUR	1.228,500	373.464,00	0,70
IT0005211237	Italgas S.P.A.		STK	64.706	74.464	9.758	EUR	5,512	356.659,47	0,67
FR0000121485	Kering S.A.		STK	487	487	0	EUR	737,000	358.919,00	0,67
FI0009000202	Kesko Oyj		STK	11.878	18.404	6.526	EUR	31,150	369.999,70	0,69
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE		STK	535	754	219	EUR	661,300	353.795,50	0,66
FR0000053225	Metropole Television S.A.		STK	21.762	23.262	1.500	EUR	17,740	386.057,88	0,72
FI0009013296	Neste Oyj		STK	6.853	8.277	1.424	EUR	51,640	353.888,92	0,66

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
NL0010773842	NN Group N.V.		STK	8.864	11.398	2.534	EUR 39,780	352.609,92	0,66
NL0015000AO0	NN Group N.V. - Anrechte		STK	8.731	8.731	0	EUR 0,000	0,00	0,00
FR0000120321	Oréal S.A., L'		STK	947	2.180	1.233	EUR 375,800	355.882,60	0,67
CH0024608827	Partners Group Holding AG		STK	285	285	0	CHF 1.401,500	364.374,66	0,68
SE0000106205	PEAB AB		STK	33.479	33.479	0	SEK 105,700	348.918,39	0,65
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.		STK	6.653	7.600	947	EUR 53,940	358.862,82	0,67
FR0014003307	Publicis Groupe S.A. - Anrechte		STK	6.734	6.734	0	EUR 0,000	0,00	0,00
NL0000379121	Randstad N.V.		STK	5.622	7.703	2.081	EUR 64,500	362.619,00	0,68
GB00B5ZN1N88	Segro PLC		STK	28.833	28.833	0	GBP 10,945	367.612,78	0,69
CH0418792922	Sika AG		STK	1.355	1.700	345	CHF 302,500	373.916,71	0,70
IT0003153415	Snam S.p.A.		STK	72.424	155.910	83.486	EUR 4,875	353.067,00	0,66
GB00BYZDVK82	Softcat PLC		STK	17.962	22.463	4.501	GBP 17,760	371.605,94	0,70
CH0008742519	Swisscom AG		STK	753	880	127	CHF 528,200	362.830,32	0,68
FR0000054900	Television Fse 1 S.A. (TF1)		STK	45.114	45.114	0	EUR 8,525	384.596,85	0,72
FR0000127771	Vivendi S.A.		STK	12.500	28.673	16.173	EUR 28,330	354.125,00	0,66
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V.		STK	4.491	9.972	5.481	EUR 84,720	380.477,52	0,71
							EUR	12.350.649,97	23,16
Andere Wertpapiere									
Ausland									
CH0012032048	Roche Holding AG - Genussscheine		CHF	1.153	672	214	% EUR 348,550	366.610,24	0,69
							EUR	366.610,24	0,69
Investmentanteile									
Gruppeneigene Investmentanteile									
FR0010609115	LA FRANCAISE - LF Trésorerie		ANT	20	27	7	EUR 107.398,800	2.147.976,00	4,03

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
FR0013431194	La Francaise-LF Carb.Imp.2026		ANT	5.150	7.150	2.000	EUR 1.035,200	5.331.280,00	10,00
FR0010674978	La Française Sub Debt FCP		ANT	4.035	4.500	465	EUR 2.391,910	9.651.356,85	18,09
FR0010934257	LA FRNSE-La Fran.Oblig.Eur.SAI		ANT	4.150	5.800	1.650	EUR 1.280,700	5.314.905,00	9,96
Gruppenfremde Investmentanteile									
DE000ETFL177	Deka Dt.B.EUROG.Ger. U.ETF		ANT	53.000	95.000	42.000	EUR 100,520	5.327.560,00	9,99
DE0005933956	iShares Core EO STOX.50 U.E.DE		ANT	32.568	19.855	28.287	EUR 41,215	1.342.290,12	2,52
IE00BJK55C48	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF		ANT	1.021.000	1.781.000	760.000	EUR 5,225	5.335.133,40	10,00
IE00BF553838	iShs II-J.P.M.ESG \$ EM B.U.ETF		ANT	1.088.000	1.253.000	165.000	EUR 5,055	5.499.296,00	10,31
								EUR 39.949.797,37	74,90
Summe Wertpapiervermögen								EUR 53.034.732,88	99,43
Derivate (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate Forderungen/Verbindlichkeiten								-111.125,00	-0,21
Aktienindex-Terminkontrakte									
EURO STOXX 50 - FUTURE 17/09/2021		EUREX	EUR	Anzahl -1				-730,00	0,00
EURO STOXX 50 - FUTURE 17/09/2021		EUREX	EUR	Anzahl -19				-7.125,00	-0,01
EURO STOXX 50 - FUTURE 17/09/2021		EUREX	EUR	Anzahl -23				-17.020,00	-0,03
EURO STOXX 50 - FUTURE 17/09/2021		EUREX	EUR	Anzahl -32				-23.040,00	-0,04
EURO STOXX 50 - FUTURE 17/09/2021		EUREX	EUR	Anzahl -88				-62.480,00	-0,12
EURO STOXX 50 - FUTURE 17/09/2021		EUREX	EUR	Anzahl -1				-730,00	0,00
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds								EUR 305.019,38	0,57
EUR-Guthaben bei: Verwahrstelle			EUR	264.235,96	%	100,000	264.235,96	0,50	

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
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
	Verwahrstelle		DKK	37.082,62			% 100,000	4.986,74	0,01
	Verwahrstelle		NOK	2.962,42			% 100,000	290,29	0,00
	Verwahrstelle		SEK	3.215,29			% 100,000	317,03	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	Verwahrstelle		AUD	1.361,86			% 100,000	862,13	0,00
	Verwahrstelle		CAD	13.152,60			% 100,000	8.956,49	0,02
	Verwahrstelle		CHF	435,30			% 100,000	397,10	0,00
	Verwahrstelle		GBP	5.166,84			% 100,000	6.018,80	0,01
	Verwahrstelle		HKD	5.234,59			% 100,000	568,39	0,00
	Verwahrstelle		JPY	1.466.354,00			% 100,000	11.140,56	0,02
	Verwahrstelle		SGD	2.160,75			% 100,000	1.355,47	0,00
	Verwahrstelle		USD	6.985,45			% 100,000	5.890,42	0,01
Sonstige Vermögensgegenstände									
	Dividendenforderungen Aktien		EUR	9.898,97			EUR	632.233,50	1,19
	Dividendenforderungen Aktien		GBP	12.840,39				9.898,97	0,02
	Futures Variation Margin		EUR	455.516,42				14.957,64	0,03
	Initial Margin		EUR	99.000,00				455.516,42	0,85
	Quellensteuererstattungsansprüche		CHF	11.157,98				99.000,00	0,19
	Quellensteuererstattungsansprüche		DKK	53.298,01				10.178,78	0,02
	Quellensteuererstattungsansprüche		EUR	32.541,22				7.167,32	0,01
	Quellensteuererstattungsansprüche		GBP	1.666,72				32.541,22	0,06
	Quellensteuererstattungsansprüche		SEK	10.462,50				1.941,55	0,00
								1.031,60	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme ²									
EUR-Kredite bei:									
	Societe Generale Paris		EUR	-137.964,67			EUR	-137.966,50	-0,26
							% 100,000	-137.964,67	-0,26
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen									
	Societe Generale Paris		USD	-2,17			% 100,000	-1,83	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten									
	Verbindlichkeiten aus Anteilrückkäufen		EUR	-309.617,86			EUR	-384.187,76	-0,72
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse I)		EUR	-18,85				-309.617,86	-0,58
								-18,85	0,00

² Kurzfristige Verbindlichkeit durch Transaktionen in Derivate und Futures

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 Verwaltungsvergütung (Klasse W)		EUR	-24,92				-24,92	0,00
	Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse R)		EUR	-74.526,13				-74.526,13	-0,14
	Fondsvermögen						EUR	53.338.706,50	100,00 ³
	Zurechnung auf Anteilscheinklassen:								
	La Française Systematic Multi Asset Allocation I ⁴								
	Anteiliges Fondsvermögen						EUR	22.887,90	
	Anteilwert						EUR	1.040,36	
	Umlaufende Anteile						STK	22	
	La Française Systematic Multi Asset Allocation W ⁵								
	Anteiliges Fondsvermögen						EUR	17.793,77	
	Anteilwert						EUR	88,97	
	Umlaufende Anteile						STK	200	
	La Française Systematic Multi Asset Allocation R ⁶								
	Anteiliges Fondsvermögen						EUR	53.298.024,83	
	Anteilwert						EUR	128,83	
	Umlaufende Anteile						STK	413.724	

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

⁴ Bis 11.05.2021 Veri Multi Asset Allocation I.

⁵ Bis 11.05.2021 Veri Multi Asset Allocation W.

⁶ Bis 11.05.2021 Veri Multi Asset Allocation R.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte:

Kurse per 30.06.2021

Devisenkurse (in Mengennotiz)

Australische Dollar (AUD)	1,57965 = 1 EUR
Britisches Pfund (GBP)	0,85845 = 1 EUR
Dänische Krone (DKK)	7,43625 = 1 EUR
Hong-Kong Dollar (HKD)	9,20950 = 1 EUR
Japanische Yen (JPY)	131,62305 = 1 EUR
Kanadische Dollar (CAD)	1,46850 = 1 EUR
Norwegische Krone (NOK)	10,20490 = 1 EUR
Schwedische Krone (SEK)	10,14200 = 1 EUR
Schweizer Franken (CHF)	1,0962 = 1 EUR
Singapur Dollar (SGD)	1,59410 = 1 EUR
US-Dollar (USD)	1,18590 = 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 (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					
DE0008404005	Allianz SE	STK	0	848	
DE0006766504	Aurubis AG	STK	5.945	5.945	
DE0005158703	Bechtle AG	STK	2.143	2.143	
DE0006083405	Hornbach Holding AG&Co.KGaA	STK	5.000	5.000	
DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG	STK	0	900	
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE	STK	28.103	28.103	
DE0007010803	RATIONAL AG	STK	0	232	
DE000A12B8Z4	TLG IMMOBILIEN AG	STK	0	8.700	
DE000UNSE018	Uniper SE	STK	0	6.021	
Ausland					
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.	STK	16.294	16.294	
US0091581068	Air Products & Chemicals Inc.	STK	0	844	
IE00BFRT3W74	Allegion PLC	STK	0	2.100	
FR0000071946	Alten S.A.	STK	4.465	4.465	
US0533321024	AutoZone Inc.	STK	0	215	
JP3937200008	Azbil Corp.	STK	0	2.200	
CH0001503199	BELIMO Holding AG	STK	0	25	
GB0000904986	Bellway PLC	STK	0	4.800	

JP3830800003	Bridgestone Corp.	STK	0	3.300
SE0000379190	Castellum AB	STK	0	10.300
JP3519400000	Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	STK	0	2.200
JP3047540004	Comforia Residential REIT Inc.	STK	0	45
GB00BD6K4575	Compass Group PLC	STK	22.529	22.529
JP3305530002	COMSYS Holdings Corp.	STK	0	4.500
US2172041061	Copart Inc.	STK	0	1.732
US2310211063	Cummins Inc.	STK	0	1.040
GB00BJQZC279	Daily Mail & General Trust PLC	STK	0	24.000
ES0127797019	EDP Renováveis S.A.	STK	17.893	17.893
FR0000130452	Eiffage S.A.	STK	0	2.300
JP3168200008	Elecom Co. Ltd.	STK	0	3.500
IT0005176406	ENAV S.p.A.	STK	0	45.000
ES0130670112	Endesa S.A.	STK	17.642	25.099
IT0003128367	ENEL S.p.A.	STK	0	22.347
US29364G1031	Entergy Corp.	STK	0	2.260
NO0010716418	Entra ASA	STK	0	10.409
NL0006294274	Euronext N.V.	STK	0	2.208
US31620R3030	Fidelity National Finl Inc.	STK	0	5.600
JP3809200003	Fuji Corp.	STK	0	7.100
DK0010272202	GENMAB AS	STK	1.351	1.351
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC	STK	0	11.500
US4165151048	Hartford Finl SvcsGrp Inc.,The	STK	0	4.380
IT0001250932	Hera S.p.A.	STK	0	62.000
US4278661081	Hershey Co., The	STK	0	1.700
US4370761029	Home Depot Inc., The	STK	0	771

US4385161066	Honeywell International Inc.	STK	0	1.171
ES06445809L2	Iberdrola S.A - Anrechte	STK	32.712	32.712
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.	STK	19.044	35.712
JP3046300004	Ichigo Office Real Estate Investment Corp.	STK	0	135
FR0004035913	Iliad S.A.	STK	2.551	2.551
JP3046500009	Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp.	STK	0	90
SE0000190126	Industrivärden AB	STK	0	6.294
US45687V1061	Ingersoll-Rand Inc.	STK	0	1.773
JP3047760008	Invesco Office J-Reit Inc.	STK	0	700
SE0000107419	Investor AB	STK	6.406	6.406
IT0003027817	Iren S.p.A.	STK	0	85.000
JP3143600009	ITOCHU Corp.	STK	0	5.800
JP3705200008	Japan Airlines Co. Ltd.	STK	0	4.400
JP3496400007	KDDI Corp.	STK	0	4.500
JP3283460008	Koei Tecmo Holdings Co. Ltd.	STK	0	2.000
FI0009013403	KONE Oyj	STK	2.797	5.982
NL0009432491	Koninklijke Vopak N.V.	STK	10.283	10.283
CH0025238863	Kühne & Nagel Internat. AG	STK	2.082	2.082
JP3254200003	Kyowa Exeo Corp.	STK	0	5.100
JP3048180008	LaSalle Logiport REIT	STK	0	95
US5253271028	Leidos Holdings Inc.	STK	0	2.330
US5398301094	Lockheed Martin Corp.	STK	0	700
CH0025751329	Logitech International S.A.	STK	5.115	5.115
JP3861600009	Maeda Road Construction Co. Ltd.	STK	0	5.500
JP3046450007	Mcubs MidCity Investment Corp.	STK	0	130
JP3919200000	Meitec Corp.	STK	0	2.400
US5949181045	Microsoft Corp.	STK	0	1.174

JP3910620008	Mirait Holdings Corp.	STK	0	8.800
JP3047750009	Nippon REIT Investment Corp.	STK	0	31
JP3735400008	Nippon Tel. and Tel. Corp.	STK	0	5.200
JP3041770003	NTT DU REIT Investment Corp.	STK	0	95
US62944T1051	NVR Inc.	STK	0	52
JP3190000004	Obayashi Corp.	STK	0	11.700
AT0000743059	OMV AG	STK	0	4.800
US7043261079	Paychex Inc.	STK	0	2.479
US7134481081	PepsiCo Inc.	STK	0	1.500
US7185461040	Phillips 66	STK	0	2.300
US7458671010	Pulte Group Inc.	STK	0	4.796
US7607591002	Republic Services Inc.	STK	0	2.560
GB0007188757	Rio Tinto PLC	STK	0	3.420
US7782961038	Ross Stores Inc.	STK	0	1.716
LU0061462528	RTL Group S.A.	STK	9.800	9.800
US78409V1044	S&P Global Inc.	STK	0	691
JP3326000001	Sankyu Inc.	STK	0	2.600
JP3400400002	SCSK Corp.	STK	0	2.500
JP3420600003	Sekisui House Ltd.	STK	0	6.200
JP3371200001	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	STK	0	600
US74144T1088	T. Rowe Price Group Inc.	STK	0	1.568
US8793601050	Teledyne Technologies Inc.	STK	0	575
US8725401090	TJX Companies Inc.	STK	0	3.413
JP3594000006	Toshiba TEC Corp.	STK	0	3.200
IT0004827447	UnipolSai Assicurazioni S.p.A.	STK	82.175	176.175
ES0183746314	Vidrala S.A.	STK	0	2.176

FR0000125486	VINCI S.A.	STK	0	2.400
US92826C8394	VISA Inc.	STK	0	990
US9311421039	Walmart Inc.	STK	0	1.499
US94106L1098	Waste Management Inc. (Del.)	STK	0	1.794
US9884981013	Yum! Brands, Inc.	STK	0	2.132
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK	0	502
Verzinsliche Wertpapiere				
Inland				
DE000BHY0MQ1	0,3750 % Berlin Hyp AG - Pfandbriefe 2017/2025	EUR	0	1.000
DE000A2AAX45	0,1000 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2016/2026	EUR	0	1.300
DE000A14J5J4	0,5000 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2015/2027	EUR	0	1.300
DE000A2AAW53	0,5000 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2017/2026	EUR	0	1.000
DE000A12UGG2	1,1250 % DZ HYP AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2014/2024	EUR	0	1.000
DE000HSH5Y29	0,3750 % HSH Nordbank AG - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2016/2023	EUR	0	900
DE000MHB13J7	0,5000 % Münchener Hypothekenbank - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2015/2025	EUR	0	1.000
DE000MHB06J1	1,7500 % Münchener Hypothekenbank - Medium Term Hyp. Pfandbriefe 2012/2022	EUR	0	2.000
DE000NLB85X6	0,2500 % Norddeutsche Landesbank -GZ- - Öff. MT Pfandbriefe 2016/2026	EUR	0	1.000
Ausland				
XS0825855751	2,2500 % Fortum Oyj - Medium Term Notes 2012/2022	EUR	0	706
XS1139315581	1,3750 % Total Capital Intl S.A. - Medium Term Notes 2014/2025	EUR	0	400
Investmentanteile				
Gruppeneigene Investmentanteile				
FR0013289022	La Française SICAV - La Française Trésorerie	ANT	84.600	84.600
Gruppenfremde Investmentanteile				
LU1865033333	DWS Concept SICAV - Dividend Equity Risk Control	ANT	31.131	31.131

IE00B1FZS798	iShsII-\$ Treas.Bd 7-10yr U.ETF	ANT	54.400	54.400	
FR0013289022	La Française SICAV - La Française Trésorerie	ANT	84.600	84.600	
LU1190417599	Lyxor Index Fund SICAV - Lyxor Smart Overnight Return	ANT	0	7.000	
LU0290358497	Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ETF	ANT	0	50.000	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte					
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 - FUTURE)					16.818
Verkaufte Kontrakte					
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 - FUTURE)					12.432

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Wertpapier-Darlehen erzielte zugrundeliegende Exposure EUR -111.125,00

Das durch Derivate erzielte Exposure wurde gemäß § 16 Abs. 7 DerivateV ermittelt. Dabei wurde der Marktwert des zugrundeliegenden Basiswertes EURO STOXX 50 herangezogen.

Vertragspartner der derivativen Geschäfte

Societe Generale Paris

Sonstige Angaben

La Française Systematic Multi Asset Allocation I ⁷

International Security Identification Number (ISIN)

Anteilwert

EUR

DE000A0MKQQ4

1.040,36

Umlaufende Anteile

STK

22

Anleger

Private Anleger

Mindestanlagesumme

1.000.000 EUR

Fondsauflage

19.02.2014

Aktueller Ausgabeaufschlag

%

0,00

Aktueller Rücknahmeabschlag

%

0,00

Verwaltungsvergütung p. a.

%

0,70

Ertragsverwendung

ausschüttend

La Française Systematic Multi Asset Allocation W ⁸

International Security Identification Number (ISIN)

Anteilwert

EUR

DE000A1W2AF2

88,97

Umlaufende Anteile

STK

200

Anleger

Private Anleger

Mindestanlagesumme

keine

Fondsauflage

18.03.2015

Aktueller Ausgabeaufschlag

%

5,00

Aktueller Rücknahmeabschlag

%

0,00

Verwaltungsvergütung p. a.

%

1,40

Ertragsverwendung

ausschüttend

⁷ Bis 11.05.2021 Veri Multi Asset Allocation I.

⁸ Bis 11.05.2021 Veri Multi Asset Allocation W.

La Française Systematic Multi Asset Allocation R ⁹

International Security Identification Number (ISIN)

Anteilwert**Umlaufende Anteile**

Anleger

Mindestanlagesumme

Fondsauflage

Aktueller Ausgabeaufschlag

Aktueller Rücknahmeabschlag

Verwaltungsvergütung p. a.

Ertragsverwendung

EUR**STK**

DE0009763235

128,83**413.724**

Private Anleger

keine

03.08.1970

%

5,00

%

0,00

%

1,40

ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)**99,43****Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)****-0,21****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

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. Seit dem 18. Mai 2021 werden für alle Anteilscheinklassen keine erfolgsabhängigen Vergütungen mehr erhoben.

⁹ Bis 11.05.2021 Veri Multi Asset Allocation R.

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