

Halbjahresbericht La Française Systematic Multi Asset Allocation

vom 01.01.2026 bis 30.06.2026

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
Mark Wolter

www.la-francaise-systematic-am.com

La Française Systematic Multi Asset Allocation

Vermögensübersicht zum 30. Juni 2026

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens
I. Vermögensgegenstände		28.028.423,50	100,30
1. Aktien		6.232.405,49	22,30
- Aeronautik und Weltraum	61.092,92		0,22
- Banken	603.662,04		2,16
- Bau und Baustoffe	409.955,51		1,47
- Bergbau	15.350,92		0,05
- Chemische Industrie	148.332,88		0,53
- Einzelhandel	276.603,75		0,99
- Elektrik / Elektronik	227.669,34		0,81
- Energieversorger	756.588,05		2,71
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	238.291,19		0,85
- Pharmaindustrie / Biotech	652.563,10		2,34
- Real Estate	357.070,98		1,28
- Sonstige Dienstleistungen	254.463,02		0,91
- Sonstige Finanzdienstleistungen	27.283,75		0,10
- Sonstige industrielle Werte	79.608,04		0,28
- Telekommunikation	511.840,72		1,83
- Transportation	227.138,70		0,81
- Verbrauchsgüter	658.534,60		2,36
- Versicherungen	726.355,98		2,60
2. Investmentanteile		18.929.852,43	67,74
- Deutschland	4.630.703,15		16,57
- Frankreich	5.410.603,63		19,36
- Irland	8.888.545,65		31,81
3. Derivate		32.502,28	0,12
4. Forderungen		64.793,54	0,23
5. Bankguthaben		2.144.213,95	7,67
6. Sonstige Vermögensgegenstände		624.655,81	2,24
II. Verbindlichkeiten		-82.945,15	-0,30
III. Fondsvermögen		27.945.478,35	100 ¹⁾

1) Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

La Française Systematic Multi Asset Allocation

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2026

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2026	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fondsver- mögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE0008404005	Allianz SE		STK	66	0	13	EUR	414,100	27.330,60	0,10
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	539	539	0	EUR	53,100	28.620,90	0,10
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	941	0	1.060	EUR	23,850	22.442,85	0,08
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA		STK	1.628	978	1.062	EUR	39,970	65.071,16	0,23
DE0006602006	GEA Group AG		STK	1.984	128	289	EUR	60,050	119.139,20	0,43
DE0008402215	Hannover Rück SE		STK	128	128	0	EUR	242,400	31.027,20	0,11
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA		STK	1.855	0	87	EUR	73,540	136.416,70	0,49
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG		STK	238	238	0	EUR	101,600	24.180,80	0,09
DE000LEG1300	LEG Immobilien SE - Anrechte		STK	908	908	0	EUR	2,920	2.651,36	0,01
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE		STK	908	908	0	EUR	55,250	50.167,00	0,18
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	48	48	0	EUR	488,500	23.448,00	0,08
							EUR	530.495,77	1,90	
Ausland										
GB00B1YW4409	3i Group PLC		STK	793	220	0	GBP	24,860	22.885,98	0,08
CH0012221716	ABB Ltd.		STK	327	327	0	CHF	87,580	31.053,03	0,11
ES0105046017	Aena SME S.A.		STK	4.616	0	1.348	EUR	26,660	123.062,56	0,44
BE0974264930	AGEAS SA/NV		STK	1.148	847	174	EUR	70,000	80.360,00	0,29
NL0011194037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.		STK	2.983	2.843	800	EUR	35,220	105.061,26	0,38
IE00BFOL3536	AIB Group PLC		STK	2.785	0	670	EUR	10,275	28.615,88	0,10
SE0000695876	Alfa Laval AB		STK	493	0	641	SEK	577,000	25.708,18	0,09
FR0004125920	Amundi S.A.		STK	325	0	72	EUR	83,950	27.283,75	0,10
NL0010273215	ASML Holding N.V.		STK	29	29	0	EUR	1.721,400	49.920,60	0,18
NL0011872643	ASR Nederland N.V.		STK	421	0	105	EUR	66,040	27.802,84	0,10
GB0009895292	AstraZeneca PLC		STK	648	648	0	GBP	141,000	106.069,19	0,38
FR0000120628	AXA S.A.		STK	704	0	0	EUR	43,850	30.870,40	0,11
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent.		STK	1.276	0	354	EUR	21,870	27.906,12	0,10
IT0005218380	Banco BPM S.p.A.		STK	2.114	0	0	EUR	15,110	31.942,54	0,11
ES0113679137	Bankinter S.A.		STK	1.994	0	0	EUR	14,640	29.192,16	0,10
AT0000BAWAG2	BAWAG Group AG		STK	181	181	0	EUR	175,300	31.729,30	0,11
FR0000120503	Bouygues S.A.		STK	2.360	0	1.160	EUR	48,810	115.191,60	0,41
IT0000066123	BPER Banca S.p.A.		STK	2.141	0	699	EUR	13,732	29.400,21	0,11
FR0006174348	Bureau Veritas SA		STK	4.512	0	370	EUR	26,780	120.831,36	0,43
DK0010181759	Carlsberg AS		STK	216	216	0	DKK	856,800	24.758,86	0,09
GB00B033F229	Centrica PLC		STK	50.157	37.377	33.935	GBP	1,709	99.481,34	0,36
GB00BDCPN049	Coca-Cola Europacific Pa. PLC		STK	1.559	0	166	EUR	87,800	136.880,20	0,49
GB00BD6K4575	Compass Group PLC		STK	4.880	233	0	USD	32,300	137.867,58	0,49
FR0000064578	Covivio S.A.		STK	436	436	0	EUR	53,600	23.369,60	0,08
FR0000045072	Crédit Agricole S.A.		STK	4.862	0	3.122	EUR	17,595	85.546,89	0,31
NO0010161896	DNB Bank ASA		STK	903	0	251	NOK	294,700	23.521,82	0,08
FI0009007884	Elisa Oyj		STK	1.630	774	0	EUR	36,740	59.886,20	0,21
GB00BL6K5J42	Endeavour Mining PLC		STK	357	2.902	2.545	GBP	37,040	15.350,92	0,05
IT0003128367	ENEL S.p.A.		STK	2.518	2.518	0	EUR	10,054	25.315,97	0,09
FR0010208488	Engie S.A.		STK	4.266	0	3.079	EUR	27,590	117.698,94	0,42
AT0000652011	Erste Group Bank AG		STK	250	0	118	EUR	117,100	29.275,00	0,10
SE0009922164	Essity AB		STK	5.371	4.168	0	SEK	274,300	133.146,43	0,48
NL0015001FS8	Ferrovial SE		STK	457	0	143	EUR	59,980	27.410,86	0,10
CH0030170408	Geberit AG		STK	207	12	16	CHF	539,800	121.158,69	0,43
FR0010533075	Getlink SE		STK	6.380	6.380	0	EUR	18,600	118.668,00	0,42
CH0010645932	Givaudan SA		STK	40	2	0	CHF	3.420,000	148.332,88	0,53
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA		STK	5.400	303	224	NOK	267,800	127.822,51	0,46
GB00BN7SWP63	GSK PLC		STK	5.060	0	2.470	GBP	19,810	116.367,08	0,42
GB0004052071	Halma PLC		STK	2.672	1.990	0	GBP	39,340	122.029,81	0,44
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.		STK	5.437	0	2.933	EUR	21,840	118.744,08	0,42
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA		STK	2.074	0	896	EUR	55,120	114.318,88	0,41
NL0011821202	ING Groep N.V.		STK	1.205	0	0	EUR	27,670	33.342,35	0,12
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.		STK	4.787	0	0	EUR	5,990	28.674,13	0,10
FR0010259150	Ipsen S.A.		STK	150	150	0	EUR	168,800	25.320,00	0,09
IT0005211237	Italgas S.p.A.		STK	2.394	2.394	0	EUR	10,135	24.263,19	0,09
BE0003565737	KBC Groep N.V.		STK	216	0	49	EUR	119,300	25.768,80	0,09
FR0000121964	Klépierre S.A.		STK	3.618	0	470	EUR	36,580	132.346,44	0,47
NL0000009082	Kon. KPN N.V.		STK	25.859	0	7.082	EUR	4,316	111.607,44	0,40
FI0009013403	KONE Oyj		STK	933	286	1.180	EUR	49,760	46.426,08	0,17
FR0010307819	Legrand S.A.		STK	167	167	0	EUR	147,700	24.665,90	0,09
ES0124244E34	Mapfre S.A.		STK	6.055	6.055	0	EUR	4,330	26.218,15	0,09
NO0003054108	Mowi ASA		STK	1.316	1.316	0	NOK	182,800	21.263,52	0,08
GB00BM8PJY71	NatWest Group PLC		STK	3.391	0	1.765	GBP	6,670	26.257,22	0,09
FI0009013296	Neste Oyj		STK	4.918	6.343	6.857	EUR	28,640	140.851,52	0,50
CH0038863350	Nestlé S.A.		STK	1.457	1.133	0	CHF	83,080	131.252,44	0,47
NL0010773842	NN Group N.V.		STK	349	0	98	EUR	76,660	26.754,34	0,10
FI4000297767	Nordea Bank Abp		STK	5.351	3.158	0	EUR	16,600	88.826,60	0,32
CH0012005267	Novartis AG		STK	940	0	318	CHF	126,580	129.016,21	0,46
FR0000133308	Orange S.A.		STK	6.929	0	2.829	EUR	16,505	114.363,15	0,41
FI0009014377	Orion Corp.		STK	347	347	419	EUR	71,950	24.966,65	0,09
NO0003733800	Orkla ASA		STK	11.015	8.072	0	NOK	104,200	101.450,74	0,36
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A.		STK	2.790	1.589	1.817	EUR	28,620	79.849,80	0,29
GB0007099541	Prudential PLC		STK	1.895	1.895	0	GBP	10,030	22.065,07	0,08
IT0003828271	Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA		STK	519	0	0	EUR	51,300	26.624,70	0,10
FR0010451203	Rexel S.A.		STK	677	677	0	EUR	38,210	25.868,17	0,09
GB00B63H8491	Rolls Royce Holdings PLC		STK	1.812	1.812	0	GBP	14,446	30.387,92	0,11
FR0000073272	SAFRAN		STK	89	0	0	EUR	345,000	30.705,00	0,11
FI4000552500	Sampo OYJ		STK	11.049	0	2.636	EUR	9,194	101.584,51	0,36
SE0000667891	Sandvik AB		STK	685	685	0	SEK	399,900	24.756,57	0,09

CH1256740924	SGS S.A.	STK	1.315	1.315	0	CHF	93,720	133.631,66	0,48
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC	STK	1.000	0	0	GBP	25,600	29.719,06	0,11
IT0003153415	Snam S.p.A.	STK	18.628	0	7.781	EUR	6,316	117.654,45	0,42
SE0000242455	Swedbank AB	STK	865	0	170	SEK	362,000	28.299,14	0,10
CH0008038389	Swiss Prime Site AG	STK	838	838	1.126	CHF	131,900	119.850,58	0,43
CH0126881561	Swiss Re AG	STK	176	0	0	CHF	128,500	24.522,63	0,09
CH0008742519	Swisscom AG	STK	170	0	55	CHF	623,500	114.930,88	0,41
SE0005190238	Tele2 AB	STK	1.366	0	486	SEK	168,650	20.820,24	0,07
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M.Erics.	STK	2.415	0	1.433	SEK	108,150	23.604,36	0,08
NO0010063308	Telenor ASA	STK	1.633	1.633	0	NOK	141,800	20.467,53	0,07
SE0000667925	Telia Company AB	STK	5.559	0	2.771	SEK	47,210	23.718,07	0,08
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA	STK	10.994	10.994	0	EUR	10,240	112.578,56	0,40
DK0060636678	Tryg AS	STK	6.018	6.018	6.200	DKK	148,900	119.879,36	0,43
FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield SE	STK	280	280	0	EUR	102,450	28.686,00	0,10
IT0005239360	UniCredit S.p.A.	STK	415	0	0	EUR	78,260	32.477,90	0,12
IT0004810054	Unipol Gruppo S.p.A.	STK	1.258	1.258	0	EUR	24,410	30.707,78	0,11
FR0000125486	VINCI S.A.	STK	181	0	58	EUR	127,800	23.131,80	0,08
SE0000115446	Volvo (publ), AB	STK	815	815	1.095	SEK	329,500	24.269,54	0,09
FI0009003727	Wärtsilä Corp.	STK	710	710	0	EUR	33,380	23.699,80	0,08
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK	40	0	182	CHF	598,600	25.962,59	0,09
							EUR	5.675.928,04	20,31
Andere Wertpapiere									
Ausland									
CH1499059983	Roche Holding AG - Genuss-scheine	STK	72	438	366	CHF	332,800	25.981,68	0,09
							EUR	25.981,68	0,09
Investmentanteile									
Gruppeneigene Investmentanteile									
FR0013439155	LA FRANCAISE - LF								
	Glbl.FI.Rat.Fonds	ANT	1.843	1.843	0	EUR	1.179,110	2.173.099,73	7,78
FR0010609115	LA FRANCAISE - LF Trésorerie	ANT	3	21	19	EUR	118.947,57	327.105,82	1,17
FR0010955476	La Française Obligations Europe SAI	ANT	287	0	21	EUR	10.154,18	2.910.398,08	10,41
							EUR	5.410.603,63	19,36
Gruppenfremde Investmentanteile									
DE000ETFL177	Deka Dt.B.EUROG.Ger. U.ETF	ANT	32.178	0	1.405	EUR	90,068	2.898.208,10	10,37
DE0005933956	iShares Core EO STOXX.50								
	U.E.DE	ANT	26.923	23.462	19.316	EUR	64,350	1.732.495,05	6,20
IE00BJK55C48	iShs II-E.H.Yd Co.Bd ESG U.ETF	ANT	469.101	0	32.932	EUR	5,914	2.774.263,31	9,93
IE00BF553838	iShs II-J.P.M.ESG \$ EM B.U.ETF	ANT	254.239	0	17.181	EUR	5,624	1.429.840,14	5,12
IE00BYZTVV78	iShsII-EO C.Bd 0-3yr ESG U.ETF	ANT	658.133	0	79.146	EUR	4,945	3.254.665,12	11,65
IE00BD4DXB77	Xtrackers ESG USD Emerging Markets Bond Quality Weighted	ANT	170.386	0	0	EUR	8,391	1.429.777,08	5,12
							EUR	13.519.248,80	48,38
Summe Wertpapiervermögen							EUR	25.162.257,92	90,04
Derivate								32.502,28	0,12
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
S&P 500 E-MINI FUTURE 18/09/2026	CME	USD	Anzahl 17					36.578,33	0,13
S&P 500 E-MINI FUTURE 18/09/2026	CME	USD	Anzahl 5					9.839,94	0,04
S&P 500 E-MINI FUTURE 18/09/2026	CME	USD	Anzahl 1					-2.295,99	-0,01
EURO STOXX 50 - FUTURE 18/09/2026	EUREX	EUR	Anzahl -14					-11.620,00	-0,04
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	2.144.213,95	7,67
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle		EUR	19.404,84			%	100,000	19.404,84	0,07
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle		DKK	77.149,18			%	100,000	10.321,17	0,04
Verwahrstelle		NOK	3.250,02			%	100,000	287,27	0,00
Verwahrstelle		SEK	3.215,29			%	100,000	290,58	0,00

Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen						
Verwahrstelle	AUD	1.361,86	%	100,000	825,24	0,00
Verwahrstelle	CAD	13.152,64	%	100,000	8.108,65	0,03
Verwahrstelle	CHF	435,30	%	100,000	472,00	0,00
Verwahrstelle	GBP	5.166,86	%	100,000	5.998,21	0,02
Verwahrstelle	HKD	5.234,61	%	100,000	583,84	0,00
Verwahrstelle	JPY	14.933.772,00	%	100,000	80.369,12	0,29
Verwahrstelle	SGD	2.160,75	%	100,000	1.461,15	0,01
Verwahrstelle	USD	1.911.874,80	%	100,000	1.672.242,46	5,98
Societe Generale Paris	USD	610.660,91	%	100,000	534.121,32	1,91
Sonstige Vermögensgegenstände						
Dividendenforderungen Aktien	EUR	-0,01			689.449,35	2,47
Dividendenforderungen Aktien	GBP	1.240,84			-0,01	0,00
Dividendenforderungen Aktien	USD	1.244,40			1.440,49	0,01
Futures Variation Margin	EUR	11.620,00			1.088,43	0,00
Initial Margin	EUR	58.806,90			11.620,00	0,04
Initial Margin	USD	633.649,91			58.806,90	0,21
Quellensteuererstattungsansprüche	CHF	34.053,60			554.228,91	1,98
Quellensteuererstattungsansprüche	DKK	22.955,57			36.924,48	0,13
Quellensteuererstattungsansprüche	EUR	20.243,10			3.071,04	0,01
Quellensteuererstattungsansprüche	GBP	930,71			20.243,10	0,07
Quellensteuererstattungsansprüche	SEK	10.462,50			1.080,46	0,00
					945,55	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme						
EUR-Kredite bei:					EUR	-1,18
Societe Generale Paris	EUR	-190.271,57	%	100,000		0,00
					-190.271,57	-0,68
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen						
Societe Generale Paris	JPY	-62,00	%	100,000		
					-0,33	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten					EUR	-82.945,15
Futures Variation Margin	USD	-50.445,00				-0,30
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse I)	EUR	-14,12			-44.122,28	-0,16
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse W)	EUR	-39,94			-14,12	0,00
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung (Klasse R)	EUR	-38.768,81			-39,94	0,00
					-38.768,81	-0,14
Fondsvermögen					EUR	27.945.478,35
Zurechnung auf Anteilscheinklassen:						100,00 ²⁾
La Française Systematic Multi Asset Allocation I						
Anteiliges Fondsvermögen					EUR	17.363,18
Anteilwert					EUR	1.194,82
Umlaufende Anteile					STK	15
La Française Systematic Multi Asset Allocation W						
Anteiliges Fondsvermögen					EUR	28.803,39
Anteilwert					EUR	97,51
Umlaufende Anteile					STK	295
La Française Systematic Multi Asset Allocation R						
Anteiliges Fondsvermögen					EUR	27.899.311,78
Anteilwert					EUR	142,49
Umlaufende Anteile					STK	195.801

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 30.06.2026

Devisenkurse (in Mengennotiz)

Australische Dollar (AUD)	1,65025 = 1 EUR
Britisches Pfund (GBP)	0,8614 = 1 EUR
Dänische Krone (DKK)	7,47485 = 1 EUR
Hong-Kong Dollar (HKD)	8,9658 = 1 EUR
Japanische Yen (JPY)	185,8148 = 1 EUR
Kanadische Dollar (CAD)	1,62205 = 1 EUR
Norwegische Krone (NOK)	11,3135 = 1 EUR
Schwedische Krone (SEK)	11,065 = 1 EUR
Schweizer Franken (CHF)	0,92225 = 1 EUR
Singapur Dollar (SGD)	1,4788 = 1 EUR
US-Dollar (USD)	1,1433 = 1 EUR

Marktschlüssel

Terminbörsen

CME	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
EUREX	European Exchange

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheinanleihen (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					
DE0005439004	Continental AG	STK	0	472	
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK	0	197	
DE000ENAG999	E.ON SE	STK	0	8.623	
DE0007164600	SAP SE	STK	0	589	
DE000A12DM80	Scout24 AG	STK	0	251	
Ausland					
ES0167050915	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA	STK	0	394	
ES06670509S9	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA - Anrechte	STK	295	295	
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.	STK	0	397	
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A.	STK	0	859	
IT0004776628	Banca Mediolanum S.p.A.	STK	0	1.574	
ES0113860A34	Banco de Sabadell S.A.	STK	0	8.047	
ES0113900J37	Banco Santander S.A.	STK	0	3.028	
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK	0	362	
GB0030913577	BT Group PLC	STK	0	12.391	
ES0140609019	Caixabank S.A.	STK	0	2.980	
FR0000120644	Danone S.A.	STK	0	1.813	
DK0010274414	Danske Bank AS	STK	0	793	
NL0006294274	Euronext N.V.	STK	0	1.053	
NL00150743B8	Ferrovial N.V. - Anrechte	STK	457	457	
GB0005405286	HSBC Holdings PLC	STK	0	2.228	
ES06445809V1	Iberdrola S.A. - Anrechte	STK	6.877	6.877	
GB0031638363	Intertek Group PLC	STK	0	497	
PTJMT0AE0001	Jerónimo Martins, SGPS, S.A.	STK	0	6.476	
FI0009000202	Kesko Oyj	STK	0	1.290	
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC	STK	22.430	22.430	
CH0025751329	Logitech International S.A.	STK	1.429	1.429	
GB00BKFB1C65	M&G PLC	STK	7.616	7.616	
GB0006776081	Pearson PLC	STK	0	11.070	
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group	STK	0	471	
GB00BSZBP530	Reckitt Benckiser Group PLC	STK	356	356	
GB00B2B0DG97	Relx PLC	STK	0	658	
GB00B019KW72	Sainsbury PLC, J.	STK	6.733	6.733	
CH1527467646	SGS S.A. - Anrechte	STK	1315	1.315	
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken	STK	0	1.588	
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB	STK	0	2.385	
CH0014852781	Swiss Life Holding AG	STK	0	40	
GB00BLGZ9862	Tesco PLC	STK	0	24.022	
GB00BVZK7T90	Unilever PLC	STK	0	2.334	

Andere Wertpapiere				
Ausland				
CH0012032048	Roche Holding AG - Genussscheine	CHF	0	487
Investmentanteile				
Gruppeneigene Investmentanteile				
FR0013431178	La Française Carbon Impact 2026	ANT	0	2.112
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)				
Terminkontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte				15.238
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 - FUTURE, S&P 500 E-MINI FUTURE)				
Verkaufte Kontrakte				9.949
(Basiswert(e): EURO STOXX 50 - FUTURE)				

La Française Systematic Multi Asset Allocation

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR **32.502,28**

Das durch Derivate erzielte Exposure wurde gemäß § 16 Abs. 7 DerivateV ermittelt. Dabei wurden die Marktwerte der zugrundeliegenden Basiswerte S&P 500 E-MINI FUTURE, EURO STOXX 50 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	1.194,82
Umlaufende Anteile	STK	15
Auflagedatum		19.02.2014
Mindestanlagesumme	EUR	1.000.000,00
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	97,51
Umlaufende Anteile	STK	295
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	142,49
Umlaufende Anteile	STK	195.801,29
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 %) **90,04**

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) **0,12**

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2026 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 30.06.2026 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 der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

Frankfurt am Main, den 06. August 2026

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
€ 5,0 Mio., Stand 31.12.2025
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
€ 2,6 Mio., Stand 31.12.2025

Gesellschafter

Groupe La Française
Paris

Geschäftsführer

Berit Jauch
20355 Hamburg

Dennis Jeske
63128 Dietzenbach

Mark Wolter
53925 Kall

Verwahrstelle

BNP Paribas S.A.
Niederlassung Deutschland
Senckenberganlage 19
60325 Frankfurt am Main
Haftendes Eigenkapital: € 98.265 Mio.
Stand 31.12.2025

Wirtschaftsprüfer

FFA Frankfurt Finance Audit GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Isabelle Kintz-Blouquy

Relationship Management der Groupe
La Française International Entities
LFFS Luxembourg Branch, Luxembourg
Vorsitzende

Paul Gurzal

Co-Head of Fixed Income & Head Quantitative Hub
Credit Mutuel Asset Management, Frankreich
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 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