

Pressemitteilung

Frankfurt, 12. Mai 2022

Nachhaltiger und diversifizierter: La Française Systematic European Equities

- CO₂-Fußabdruck des Europafonds deutlich gesunken
- Neue Portfoliokonstruktion auf Basis einer Minimum-Varianz-Optimierung

La Française Systematic Asset Management hat die Portfoliokonstruktion seines europäischen Multi-Faktor-Aktienfonds angepasst. Ab sofort zählen 100 statt der bisher 36 europäischen Titel zum Portfolio des La Française Systematic European Equities (DE0009763201 [R], DE000A0MKQJ9 [I]). Die besten 100 Aktien des Multi-Faktor-Modells werden auf Basis einer Minimum-Varianz-Optimierung gewichtet. Diese Änderung wurde mit der letzten quartalsweise stattfindenden Reallokation vollzogen.

„Mit der optimierten Portfoliokonstruktion erhöhen wir den Diversifizierungsgrad des Portfolios und steigern gleichzeitig das Markt-Beta“, so Dennis Jeske, Geschäftsführer für das Portfoliomanagement bei La Française Systematic Asset Management. „Des Weiteren fließen neue faktorbasierte Research-Analysen in den Anlageprozess ein, um eine kontinuierliche Optimierung des Fonds zu gewährleisten.“

Der Länderschwerpunkt liegt mit 23 Werten auf Frankreich. 14 Unternehmen im Portfolio haben ihren Sitz in Großbritannien, gefolgt von Deutschland auf Platz drei mit 13 Titeln wie Roche, Beiersdorf oder RTL Group. Bei den Sektoren dominieren Finanz- (27 %) und Technologietitel (12 %), gefolgt von Nicht-Basiskonsumgüter (7 %) und Gesundheitstechnologie (7 %).

Effiziente Portfoliogestaltung

Basis der quartalsweisen Reallokation ist das eigens entwickelte, systematische Aktienselektionsmodell. Die rein quantitativen Faktoren Quality, Value, Momentum und Low Volatility stehen dabei im Mittelpunkt. Diese vier Komponenten der regelbasierten Analyse werden mit je 20 Prozent gewichtet. Mit weiteren 20 Prozent fließt die sogenannte Carbon-Efficiency-Ratio in das Bewertungsmodell ein. Diese misst den CO₂-Verbrauch in Tonnen pro eine Million erzielten Umsatz. Dank dieses Vorgehens werden Unternehmen bessergestellt, die CO₂-schonend wirtschaften und einen Beitrag zur Dekarbonisierung des Wirtschaftskreislaufes leisten. Der CO₂-Faktor wird vom hausinternen Sustainable Research Center in London berechnet, das eine proprietäre Methodik zur Quantifizierung der E, S und G-Werte (engl. ESG: Environmental, Sustainable, Governance) anwendet. Mit fünf Globen verfügt der Fonds zudem über das höchste Morningstar Sustainability Rating (MSR)*. „Der Fonds gehört damit zu den zehn nachhaltigsten Prozent in seiner Morningstar-Kategorie (Europe Large-Cap Blend)“, so Jeske.

„Seit Einführung unserer Carbon-Efficiency-Ratio konnten wir kontinuierlich den CO₂-Ausstoß unseres Portfolios im Vergleich zum STOXX Europe 600 reduzieren. Derzeit sparen wir durch unsere Investitionen 82 % CO₂-Emissionen ein und tragen somit zur Reduzierung der

Klimarisiken bei. Wir sind der Meinung, dass der Kapitalmarkt langfristig auf Nachhaltigkeit ausgerichtete Unternehmen belohnen wird“, so Jeske weiter.

**Morningstar Rating zum 31.03.2021.*

Weitere Informationen zum Fonds sind abrufbar unter:

<https://www.la-francaise-systematic-am.com>

Über La Française Systematic Asset Management

La Française Systematic Asset Management ist der erfahrene Spezialist für systematische, regelbasierte Investmentstrategien und ein integraler Bestandteil der La Française Gruppe. Das Geschäftsmodell der Gruppe konzentriert sich auf die Bereiche Kapitalmarkt- und Immobilienanlagen.

Als innovativer Asset Manager für quantitative Anlagestrategien liegt systematisches Investieren in unserer DNA. Wir kombinieren die langjährige Erfahrung unserer Muttergesellschaft im Bereich Nachhaltigkeit mit regelbasierten Anlagestrategien. Daraus ergeben sich robuste und maßgeschneiderte Produktlösungen für unsere Kunden.

Als Teil eines globalen Multi-Boutique Asset Managers profitieren wir vom schnellen Zugang zu Expertenwissen und firmeneigenem Research. Wir agieren flexibel und individuell auf die Bedürfnisse unserer Kunden.

Das Produktportfolio umfasst systematische Multi-Asset- und Overlay-Strategien, Aktienstrategien, REITS, Infrastruktur- und Dachfonds. Durch unsere regelbasierten Prozesse und unser eigens entwickeltes Risk@Work Modell, einem Risikomanagement System zur Begrenzung von Verlusten, mit dem wir aber auch Chancen an den Märkten gezielt nutzen.

La Française ist eine Tochtergesellschaft der Crédit Mutuel Nord Europe (CMNE), dem in Nordfrankreich führenden Allfinanzkonzern. Die CMNE gehört zu den größten genossenschaftlich organisierten Banken Frankreichs.

Über La Française

Ökologische und gesellschaftliche Herausforderungen sind Möglichkeiten, die Zukunft neu zu denken. Künftiges Wachstum und Leistung werden an neu identifizierten Einflüssen anknüpfen. Die vorausschauende Investmentstrategie des Managements der La-Française-Gruppe baut auf dieser Überzeugung auf.

La Française hat ein Multi-Boutique-Modell entwickelt, um institutionelle und private Kunden in Frankreich und im Ausland zu bedienen, das sich auf zwei Geschäftsbereiche konzentriert: Finanz- und Immobilienanlagen.

La Française ist sich der Bedeutung der umfassenden Veränderungen in unserer zunehmend digitalen und vernetzten Welt bewusst. Die aus diesem Grund geschaffene Innovationsplattform führt die neuen Tätigkeiten zusammen, die als Schlüsselunternehmungen von morgen identifiziert wurden.

La Française verwaltet ein Vermögen von 55 Mrd. Euro (Stand 31.12.2021) und hat Niederlassungen in Paris, Frankfurt, Hamburg, London, Luxemburg, Madrid, Mailand, Hongkong und Seoul.

La Française ist eine Tochtergesellschaft der Caisse Régionale du Crédit Mutuel Nord Europe (CMNE). Die Groupe Crédit Mutuel verfügt über A, negativer Ausblick/A-1 S&P lang- und kurzfristigen Ratings (Juni 2021).

.....

Pressekontakt:

La Française Systematic Asset Management GmbH
Alexandra Kohlstrung
Neue Mainzer Straße 80
60311 Frankfurt

Tel. +49 (0)69. 97 57 43 -26
akohlstrung@la-francaise.com
www.la-francaise-systematic-am.de

Heidi Rauen
Tel. +49 (0)69. 33 99 78 -13
hrauen@dolphinvest.eu

Risikohinweise:

Bitte beachten Sie: Die La Française Systematic Asset Management GmbH bietet keine Anlageberatung. Die Inhalte dieser Meldung dienen ausschließlich fachlichen Informationszwecken und sind nicht als Empfehlung zu verstehen, bestimmte Transaktionen einzugehen oder zu unterlassen. Die enthaltenen Informationen wurden sorgfältig zusammengestellt. Eine Gewähr für die Richtigkeit und Vollständigkeit kann jedoch nicht übernommen werden. Die Meldung kann Links zu Webseiten anderer Anbieter enthalten, deren Inhalte von der La Française Systematic Asset Management GmbH nicht kontrolliert werden. Daher übernimmt die La Française Systematic Asset Management GmbH für derartige Inhalte keine Haftung. Darüber hinaus übernimmt die La Française Systematic Asset Management GmbH keine Haftung für in dieser Meldung von Dritten zur Verfügung gestellte Daten und Informationen. Bei den dargestellten Wertentwicklungen handelt es sich ausschließlich um Vergangenheitswerte, aus denen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung des Fonds gezogen werden können. Die Berechnung erfolgt nach der BVI-Methode. Provisionen und Kosten, die bei Ausgabe und Rücknahme von Anteilen entstehen, blieben bei der Berechnung der Wertentwicklung unberücksichtigt. Bei einem Anlagebetrag von EUR 1.000,00 über eine Anlageperiode von fünf Jahren und falls vorhanden einem Ausgabeaufschlag von z. B. 5 Prozent würde sich das Anlageergebnis im ersten Jahr um den Ausgabeaufschlag in Höhe von EUR 50,00 sowie um zusätzlich individuell anfallende Depotkosten vermindern. In den Folgejahren kann sich das Anlageergebnis zudem um individuell anfallende Depotkosten vermindern. Ausgabeaufschläge und Depotkosten reduzieren das eingesetzte Kapital sowie die dargestellte Wertentwicklung. Allein verbindliche Grundlage für den Kauf von Investmentanteilen ist der jeweils gültige Verkaufsprospekt mit den Vertragsbedingungen in Verbindung mit dem jeweils letzten Jahres- und/oder Halbjahresbericht des Fonds. Diese Unterlagen und die Wesentlichen Anlegerinformationen erhalten Sie in deutscher Sprache kostenlos bei der La Française

Systematic Asset Management GmbH und im Internet unter www.la-francaise-systematic-am.com und in Österreich bei der Zahlstelle Société Générale S.A., Paris, Zweigniederlassung Wien, Prinz-Eugen-Straße 8-10/5/TOP 11, A-1040 Wien. Bei Beschwerden können Sie sich per E-Mail an den Kundenservice von La Française Systematic Asset Management unter folgender Adresse wenden: info-am@la-francaise.com, oder an die Verbraucherschlichtungsstelle unter folgender Adresse: info@ombudsstelle-investmentfonds.de