

Pressemitteilung

Frankfurt, 5. Oktober 2023

WERBEDOKUMENT, DAS FÜR NICHT-PROFESSIONELLE ANLEGER IM SINNE VON MIFID II BESTIMMT IST

Ein Pionier geht mit der Zeit: La Française Systematic ETF Portfolio Global

- **Taktische Aktiensteuerung zur Performanceoptimierung**
- **Dekarbonisierungskomponente soll Klimaziele unterstützen**

Die La Française Systematic Asset Management hat ihren globalen Dachfonds La Française Systematic ETF Portfolio Global (ISIN: DE000A0MKQK7), klassifiziert als Artikel-8-Fonds nach der Offenlegungsverordnung¹, modernisiert: Implementierung taktischer Signale zur Steuerung des Investitionsgrades sowie Anpassung der Ländergewichtung auf Basis hausinterner Nachhaltigkeitsfaktoren.

Der aktiv gemanagte Dachfonds investiert überwiegend in ein diversifiziertes Universum von börsengehandelten Investmentfonds (ETFs). Mit diesem breit aufgestellten Fonds können Anleger an der Aktienmarktentwicklung der weltweit stärksten Wirtschaftsräume partizipieren. Die Auswahl der Märkte und der passenden ETFs erfolgt nach einem systematischen, prognosefreien Ansatz.

Mit der Steuerung des Investitionsgrades hat La Française Systematic Asset Management bereits seit 2014 gute Erfahrungen in institutionellen Portfolios gemacht. Davon sollen nun auch private Anleger profitieren. Bereits Anfang 2023 wurde deshalb dieses taktische Aktiensteuerungsmodell in den Investmentprozess integriert. Mit ihm kann der Investitionsgrad des Portfolios gesteuert werden. In guten Marktphasen kann beispielsweise auf maximal 120 % erhöht und in einem schwierigen Marktumfeld bis auf minimal 60 % reduziert werden. So konnte der La Française Systematic ETF Portfolio Global auf Jahresbasis eine absolute Performance von 14,86 % (Stand: 31.08.2023) erzielen.

Performanceübersicht 5 Jahre:

	Januar	Februar	März	April	Mai	Juni	Juli	August	September	Oktober	November	Dezember
2018										-7,30%	3,67%	-7,96%
2019	9,18%	3,90%	0,63%	4,40%	-5,41%	2,86%	2,22%	-3,70%	4,12%	1,30%	2,94%	2,65%
2020	-1,52%	-5,22%	-17,93%	11,79%	1,31%	1,00%	1,51%	4,88%	-3,17%	-0,06%	11,64%	0,51%
2021	3,93%	0,87%	2,21%	0,05%	1,22%	3,11%	-2,07%	2,30%	-1,62%	4,07%	-1,19%	1,82%
2022	-3,14%	-3,42%	0,93%	-1,80%	-3,67%	-5,96%	9,82%	-2,89%	-6,43%	3,49%	1,46%	-5,55%
2023	6,72%	0,05%	0,15%	0,15%	2,06%	4,03%	2,95%	-1,88%	-3,70%			

¹ Sustainable Finance Disclosures Regulation / Verordnung (EU) 2019/2088 DES EUROPÄISCHEN PARLAMENTS UND DES RATES vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

Neue Nachhaltigkeitskomponente

Ausgehend von der Ländergewichtung eines globalen Aktienindexes passt La Française Systematic Asset Management diese über eine Makro- sowie Mikro-Klimaanalyse an. Die Makro-Klimaanalyse bewertet die Auswirkung des Klimawandels auf die jeweiligen Länder sowie deren Maßnahmen zur Dekarbonisierung ihrer Wirtschaft und der Investitionen in erneuerbare Energien. Da beispielsweise Saudi-Arabien schlecht abschnitt, hat der Dachfonds im Gegensatz zum allgemeinen Aktienmarkt dort kein Exposure. Die Mikro-Klimaanalyse fokussiert sich hingegen auf die Bewertung der ESG-Position der Unternehmen. Neben Nachhaltigkeit fließen hier auch soziale Kennzahlen und Grundsätze der guten Unternehmensführung ein. Im Ergebnis engagiert sich der ETF Portfolio Global stärker in Ländern mit hohen Nachhaltigkeitswerten, als in solchen mit geringeren. So sind aufgrund der guten ESG-Bewertung Länder wie Japan oder die Schweiz übergewichtet.

Das Zielportfolio des ETF Portfolio Global besteht in der Regel aus 15 bis 20 ETFs. Neben den bewährten quantitativen und qualitativen Kriterien zur Auswahl der besten ETFs, investiert dieser mindestens 75 % des Portfolios in sogenannte CTB- oder PAB-ETFs. Durch die von der Europäischen Union eingeführten beiden Vorgaben zur Reduktion des Schadstoffausstoßes von Unternehmen, der Climate Transition Benchmark (CTB) und Paris-aligned Benchmark (PAB) wird die Einhaltung von EU-Mindeststandards zur Berücksichtigung von Referenzwerten für den klimabedingten Wandel sichergestellt. Zu diesem Zweck muss auf Indexebene die durchschnittliche CO₂-Intensität für PAB mindestens 50 % und für CTB immerhin noch 30 % unterhalb des Durchschnittswertes des investierbaren Universums liegen. Zusätzlich werden bestimmte Titel aufgrund besonders strenger Ausschlusskriterien vermieden. Eine jährliche Reduktion der Treibhausgas-Intensität von 7 % auf Indexebene muss außerdem eingehalten werden.

Hauptrisiken: Kapitalverlust-, Aktien-, Währungs-, Volatilitäts-, Finanz-, Derivate-, Liquiditäts-, Small-Cap- und Schwellenländerrisiko sowie das Risiko, das sich aus einem Überengagement ergibt.

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 mit dem Ziel der Begrenzung von Verlusten, mit dem wir aber auch Chancen an den Märkten gezielt nutzen.

Über La Française

Die großen Veränderungen, die mit den ökologischen und gesellschaftlichen Herausforderungen verbunden sind, sind eine Chance, die Zukunft zu überdenken. Die neuen Ansatzpunkte, die identifiziert wurden, werden das Wachstum sowie die Finanz- und Immobilienperformance von morgen bestimmen. Die zukunftsorientierte Anlagestrategie der La-Française-Unternehmensgruppe basiert auf dieser Überzeugung und Mission.

Die Unternehmensgruppe setzt ihre Innovationsfähigkeit und Technologie ein, um für ihre Kunden Anlagelösungen zu entwickeln, die Performance und Nachhaltigkeit miteinander verbinden.

La Française ist in die Geschäftsbereiche Finanz- und Immobilienanlagen aufgegliedert und konzentriert sich auf die Geschäftsentwicklung mit institutionellen und privaten Kunden in Frankreich und im Ausland.

La Française verwaltet ein Vermögen von 45 Milliarden Euro und ist in Paris, Frankfurt, Hamburg, London, Luxemburg, Madrid, Mailand, Seoul und Singapur vertreten (Stand: 30.06.2023).

La Française ist eine Tochtergesellschaft der Caisse Régionale du Crédit Mutuel Nord Europe (CMNE), einer Mitgliedsbank der Crédit Mutuel Alliance Fédérale, die von S&P (11/2022), Moody's (07/2023) und Fitch (12/2022) ein langfristiges Rating von A +/Aa3/AA- erhalten hat.

.....

Pressekontakt:

La Française Systematic Asset Management GmbH
Bianca Tomlinson
Neue Mainzer Straße 80
60311 Frankfurt
Tel. +49 (0)69 975743 03
btomlinson@la-francaise.com
<https://www.la-francaise-systematic-am.com>

Heidi Rauen +49 69 339978 13 | hrauen@dolphinvest.eu

Risikohinweise:

Ausführliche Angaben zu den Risiken sowie weitere Informationen zu den Strategien und allen Gebühren finden Sie im aktuellen Prospekt und im PRIIPs KID, die auf unserer Website unter <https://www.la-francaise-systematic-am.com/produkte/aktienfonds/details/la-francaise-systematic-etf-portfolio-global-r/> und <https://www.la-francaise-systematic-am.com/produkte/aktienfonds/details/la-francaise-systematic-etf-portfolio-global-w/> verfügbar sind.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Alle in diesen Dokumenten enthaltenen Informationen sind zum Zeitpunkt der Veröffentlichung aktuell und nach unserem besten Wissen und Gewissen korrekt.

Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen stellen weder eine Anlageberatung noch einen Anlagevorschlag oder eine Aufforderung zur Anlage an den Finanzmärkten dar.

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. 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.

Die Einstufung nach der SFDR-Verordnung ist keine Garantie für die Wertentwicklung des Fonds.

La Française Systematic Asset Management GmbH ist von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) zum Betreiben des Investmentgeschäfts zugelassen und im Handelsregister unter der Registernummer HRB 34125 eingetragen.

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