

Pressemitteilung

Frankfurt, 13. Mai 2024

La Française Systematic ETF Portfolio Global: Innovative Machine-Learning-Steuerung implementiert

Die La Française Systematic Asset Management hat in ihrem globalen Dachfonds La Française Systematic ETF Portfolio Global (ISIN: DE000A0MKQK7) zum 1. April 2024 eine innovative Komponente zur Steuerung des Aktien-Investitionsgrades eingeführt. Von der bereits für institutionelle Investoren erfolgreich eingesetzten Steuerungskomponente können nun auch Privatanleger profitieren. Die bewährte quantitative Investmentstrategie auf Basis von Verhaltensökonomie und Momentum wurde um die Verwendung modernster Methoden des maschinellen Lernens (ML) ergänzt.

ML-Modelle bieten völlig neue Einblicke in die Erfassung und Auswertung der Kapitalmarkt-Daten. Viele wirtschaftliche Beziehungen sind hoch komplex und nicht linear. Jedoch sind gerade ML-Methoden in der Lage solche Zusammenhänge umfassender zu modellieren. Darüber hinaus können sie dynamischer auf Veränderungen der Datenlage reagieren. Dr. Denisa Čumova, Head of Portfolio Management and Quantitative Research bei La Française Systematic Asset Management, erklärt: „Unser Ansatz umfasst eine breite Datengrundlage als Informationsquelle unter der Annahme, dass nicht alle Informationen bereits in den Wertpapierpreisen enthalten und relevant gewichtet sind. Unter Verwendung modernster Machine-Learning-Methoden kann unser Ansatz komplexe Zusammenhänge am Kapitalmarkt modellieren und die wesentlichen Faktoren für die Steuerung der Investitionsquote ermitteln.“

Mit der aktiven Steuerung der Aktienquote sollte die Investmentstrategie nicht nur eine relativ gute Partizipation an Trendphasen, sondern auch eine Absicherung bei fallenden Kursen bieten. In sehr guten Marktphasen kann die Aktienquote auf maximal 120 % erhöht und in einem schwierigen Marktumfeld bis auf minimal 40 % reduziert werden.

Darüber hinaus ist auch Dekarbonisierung eine wichtige Komponente der Investmentstrategie. 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.

Der aktiv gemanagte Dachfonds investiert in ein diversifiziertes Universum von börsengehandelten Investmentfonds (ETFs). Das Zielfortfolio des ETF Portfolio Global besteht in der Regel aus 15 bis 20 ETFs, deren Zusammenstellung quartalsweise überprüft und angepasst wird.

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.

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, quantitative 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 quantitativen 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 aufgliedert 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 Singapore vertreten (Stand: 30.06.2023).

La Française ist Mitglied der Crédit Mutuel Alliance Fédérale, die von S&P (11/2023), Moody's (07/2023) und Fitch (10/2023) 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>

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, bleiben 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.

Die La Française Systematic Asset Management GmbH ist von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) zum Betreiben des Investmentgeschäfts zugelassen (BaFin-ID: 10105549) 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