

PRESSEMELDUNG AUSSCHLIESSLICH FÜR PROFESSIONELLE ANLEGER IM SINNE DER MIFID II,
ZUM VERTRIEB IN ÖSTERREICH UND DEUTSCHLAND

Überarbeitetes Multifaktor-Modell von La Française Systematic European Equities 2024 auf den Prüfstand gestellt

Frankfurt Januar 21, 2025: La Française Systematic Asset Management GmbH, Mitglied von La Française, der multi-spezialisierten Vermögensverwaltungsplattform der Crédit Mutuel Alliance Fédérale, hat eindrucksvoll bewiesen, dass sich Nachhaltigkeit und finanzielle Performance erfolgreich vereinen lassen. Der quantitative europäische Aktienfonds des Asset Managers, La Française Systematic European Equities (ISIN: DE000A0MKQJ9), erzielte im Jahr 2024 einen durchschnittlich um 60 % niedrigeren CO₂-Fußabdruck als seine Benchmark und konnte dabei zugleich eine starke relative Wertentwicklung verzeichnen, die den MSCI Europe NR EUR Index übertraf. Bitte beachten Sie: Frühere Wertentwicklungen sind kein verlässlicher Indikator für zukünftige Ergebnisse.

Der La Française Systematic European Equities Fonds verfolgt einen systematischen Ansatz zur Investition in europäische Large- und Mid-Cap-Aktien. Ein Multi-Faktor-Modell bewertet das Investmentuniversum anhand von Quality-, Value-, Momentum- und Low-Volatility-Kriterien und optimiert die Aktienauswahl, um das Gesamtrisiko des Portfolios zu minimieren. Der Fonds verfolgt eine Best-in-Class-ESG-Strategie, integriert normbasierte Ausschlüsse und ist gemäß SFDR als Artikel-8-Fonds klassifiziert. Darüber hinaus wendet er einen proprietären Kohlenstoffreduktionsfilter an, der Aktien basierend auf ihren CO₂-Emissionen im Verhältnis zu ihren Faktorcharakteristika bewertet. Dies führt zu einer signifikanten Reduktion des CO₂-Fußabdrucks des Fonds, während attraktive Faktoreigenschaften erhalten bleiben. Als Aktienfonds gemäß KAGB klassifiziert, strebt der Fonds an, seine Benchmark, den MSCI Europe NR EUR Index, über einen empfohlenen Anlagehorizont von mehr als fünf Jahren hinaus zu übertreffen.

Jährliche Wertentwicklung des La Française Systematic European Equities (I-Anteil, nach Gebühren)

	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024
Annual Return										
LFSAM European Equities	20,6%	-8,0%	5,2%	-7,3%	18,7%	-0,5%	21,8%	-17,1%	12,9%	12,5%
MSCI Europe NR EUR	9,3%	2,0%	10,2%	-10,9%	26,7%	-3,1%	25,0%	-9,7%	15,8%	8,0%
Relative Rendite	11,3%	-10,1%	-5,0%	3,6%	-7,9%	2,6%	-3,2%	-7,5%	-3,0%	4,5%
Annualisierte Volatilität										
LFSAM European Equities	14,8%	15,7%	7,7%	11,4%	8,8%	24,8%	11,1%	16,8%	10,2%	8,8%
MSCI Europe NR EUR	20,2%	19,8%	8,4%	12,6%	11,4%	28,2%	12,3%	18,9%	11,4%	10,4%

Quelle: La Française Systematic Asset Management, Bloomberg

Der Fonds ist innerhalb seiner Vergleichsgruppe gut positioniert, wie die europäischen Aktienfonds-Rankings von Absolute Research über verschiedene Zeiträume (ein Jahr und zwei Jahre) belegen. Bitte beachten Sie: Frühere Wertentwicklungen sind kein verlässlicher Indikator für zukünftige Ergebnisse.

Marcel SIBBE, Senior Portfolio Manager bei La Française Systematic Asset Management, erklärte: „Trotz anhaltender wirtschaftlicher Herausforderungen und einer relativ pessimistischen Stimmung in Europa, sehen wir vielversprechende Chancen für europäische Aktien im Jahr 2025. Europäische Unternehmen generieren einen großen Teil ihrer Umsätze auf internationalen Märkten, was in Kombination mit niedrigen Bewertungen im Vergleich zu Aktien aus Regionen wie den USA attraktive Möglichkeiten schafft. Sollte sich das Sentiment verbessern, könnten sich die Bewertungsabschläge europäischer Aktien verringern, was zu höheren erwarteten Renditen führen dürfte. Zusätzlich könnten die stimulierende Geldpolitik der EZB und eine Abnahme politischer Unsicherheiten positive Impulse liefern.“

Anfang 2023 haben wir eine überarbeitete Methodik für den Fonds eingeführt. Diese umfasst die Verfeinerung der Portfoliokonstruktionsregeln und die Einführung eines Kohlenstofffilters, der Kohlenstoffreduktionsziele mit Faktoreigenschaften in Einklang bringt. Mit dieser neuen Methodik konnten wir zusätzliches Alpha generieren, was die Stärke und Robustheit unseres Multi-Faktor-Modells eindrucksvoll bestätigt. Unsere proprietäre Research-Plattform ermöglicht eine schnelle Implementierung neuer Signale sowie die Integration einer breiten Palette unterschiedlichster Daten, was zur kontinuierlichen Weiterentwicklung und Optimierung unserer Investmentstrategien beiträgt.“

La Française Systematic European Equities	
Klassifizierung	Euro Equity
Rechtsform	OGAW Investmentfonds
ISIN Code	DE000A0MKQJ9/I-Anteil EUR
Risikoindikator	4 (auf einer Skala von 1 bis 7, 7 stellt das höchste Risiko dar)
Empfohlener Anlagezeitraum	Über 5 Jahre
Benchmark	MSCI Europe NR € Index
Verwendung der Erträge	Kumulierung
Verwaltungs- und sonstige Betriebs- und Verwaltungskosten	Siehe das Dokument mit den wesentlichen Informationen
Ein-/Rücknahmekosten	0%/0%
Anfängliche Mindestzeichnung	100,000,00 EUR
Bewertung	Täglich
Die damit verbundenen Risiken umfassen	Kapitalverlust, Nachhaltigkeitsrisiken, Marktrisiko, Liquiditätsrisiko, Aktienrisiko, Volatilitätsrisiko

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 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.

Über La Française

Die La Française Gruppe bietet eine fundamentale, aktive Vermögensverwaltung, die Performance- und Nachhaltigkeitsziele über alle Anlageklassen hinweg verbindet. Unsere Spezialisten-Architektur ermöglicht es unseren Fondsmanagern, sich voll und ganz auf das zu konzentrieren, wofür sie sich jeweils in ihrem Spezialgebiet begeistern.

Unser Anteilseigner, die Crédit Mutuel Alliance Fédérale, eine Genossenschaftsgruppe und die erste „Banque à Mission“, ist der Anker für unser Engagement und unsere verantwortungsvollen Investments. Unsere Teams haben in vielen ESG-Aspekten Spitzenkompetenz entwickelt, die in sämtliche unserer Geschäftsaktivitäten und Analysen einfließt. Unser partnerschaftlicher Ansatz in der Kundenbeziehung und die Kreativität unserer Teams stellen den Kunden in den Mittelpunkt und ermöglichen die Entwicklung innovativer Lösungen und Dienstleistungen, die auf die Anlagebedürfnisse und Zeithorizonte unserer Kunden zugeschnitten sind.

Die La Française Gruppe ist die Asset-Management-Sparte der Crédit Mutuel Alliance Fédérale. Mit einem verwalteten Vermögen von 155 Milliarden Euro (30.09.2024) sind wir ein wichtiger Akteur im Bereich der Vermögensverwaltung in Frankreich und Europa. Mit mehr als 1.000 Mitarbeitern sind wir in zehn Ländern tätig, arbeiten eng mit unseren Kunden zusammen und sind dicht an den Märkten, in die wir investieren. Unsere Fachkompetenz umfassen börsennotierte und nicht-börsennotierte Vermögenswerte, einschließlich Immobilien.

Weitere Informationen finden Sie unter: [la-francaise.com](https://www.la-francaise.com)

Pressekontakt

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

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

Haftungsausschluss

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-european-equities-i/> verfügbar sind.

Die frühere Wertentwicklung ist kein Indikator für die künftige Wertentwicklung. Alle in diesem Dokument enthaltenen Informationen sind zum Zeitpunkt der Veröffentlichung gültig und nach bestem Wissen und Gewissen richtig.

Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen stellen keine Anlageberatung, keinen Anlagevorschlag oder eine Aufforderung zur Anlage in 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 gemäß SFDR-Verordnung ist keine Garantie für die Wertentwicklung des Fonds.

Die La Française Systematic Asset Management GmbH ist von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) zur Führung von Investmentgeschäften (BaFin-ID: 10105549) 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.