



Pressemitteilung

Frankfurt, 5. November 2024

## **La Française Systematic ETF Portfolio Global: Machine-Learning-Steuerung für Währungsmanagement implementiert**

***Werbedokument für professionelle und nicht-professionelle Investoren im Sinne von MIFID II. Dies ist eine Marketing-Anzeige. Bitte lesen Sie den Prospekt des La Française Systematic ETF Portfolio Global und das Basisinformationsblatt, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen.***

Die La Française Systematic Asset Management hat in ihrem globalen Dachfonds La Française Systematic ETF Portfolio Global (ISIN: DE000A0MKQK7) zum 1. Oktober 2024 eine weitere innovative Komponente eingeführt. Nach dem erfolgreichen Einsatz eines Overlays zur Steuerung des Aktien-Investitionsgrades im April dieses Jahres, kümmert sich nun ein weiteres Machine-Learning-Modell um das Währungsmanagement. Das dynamische Währungsmanagement bietet eine Partizipation an Fremdwährungspositionen bei gleichzeitiger Absicherung gegen Kursverluste. Dadurch kann ein besseres Rendite-Risiko-Verhältnis erreicht werden.

Die globale Asset-Allokation des Fonds ermöglicht es dem Anleger, Renditechancen weltweit zu nutzen. Gleichzeitig ist die Anlage in Aktien-ETFs außerhalb der Eurozone mit Fremdwährungsrisiken verbunden (insbesondere US-Dollar vs. Euro). Die Absicherungskosten der Fremdwährung können durch das dynamische Währungsoverlay verringert werden und sie kann optimal als zusätzliche Performancequelle genutzt werden. Mit dieser aktiven Steuerung können Währungsaufwertungen als zusätzliches Alpha die Rendite erhöhen.

Dr. Denisa Čumova, Head of Portfolio Management and Quantitative Research bei La Française Systematic Asset Management, erklärt: „Durch die Verwendung moderner Machine-Learning-Modelle können völlig neue Erkenntnisse über die Zusammenhänge von Kapitalmarktdaten erzielt werden. Der Einsatz von überwachten Machine-Learning-Methoden ermöglicht uns, Marktchancen besser zu nutzen. Für die Analyse verwenden wir über 500 Indikatoren von globalen Kapitalmärkten. Unterstützt wird die Entscheidungsfindung auch von unserem Momentum-Modell, das uns eine empirisch fundierte verhaltensökonomische Analyse der globalen Währungsmärkte liefert.“

Darüber hinaus ist auch Dekarbonisierung eine wichtige Komponente der Investmentstrategie des als SFDR 8 (Sustainable Finance Disclosure Regulation) klassifizierten La Française Systematic ETF Portfolio Global. Ausgehend von der Ländergewichtung eines globalen Aktienindexes passt La Française Systematic Asset Management GmbH diese über eine Makro- sowie Mikro-Klimaanalyse an. Die Makro-Klimaanalyse bewertet die Auswirkungen 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 Zielportfolio des ETF Portfolio Global besteht in der Regel aus 15 bis 20 ETFs, deren Zusammenstellung quartalsweise überprüft und ohne Ankündigung angepasst wird. Derzeit (Stand: 31.10.2024) ist der Fonds mit rund 67 % hauptsächlich in Nordamerika allokiert, gefolgt von Europa inkl. Großbritannien mit knapp 20 %. Die Performance seit Jahresbeginn beträgt 12,62 % (Stand: 31.10.2024).

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.

#### **Performanceübersicht 5 Jahre:**

| Stand      | Jahresperformance |
|------------|-------------------|
| 29.12.2023 | 16,48 %           |
| 30.12.2022 | -16,88 %          |
| 31.12.2021 | 15,47 %           |
| 31.12.2020 | 1,30 %            |
| 31.12.2019 | 27,23%            |

Quelle: Bloomberg und eigene Berechnungen

#### **Fondsinformationen:**

**Assetklasse:** Auf Euro und Fremdwährungen lautende Aktien-ETFs

**Fonds:** LA FRANÇAISE ETF PORTFOLIO GLOBAL

**ISIN:** DE000A0MKQK7

**Anlagehorizont:** > 5 Jahre

**Risikoprofil auf einer Skala von 1 bis 7, wobei 7 der höchste Wert ist:** 4

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 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 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 152 Milliarden Euro (30.06.2024) 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 unter <http://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](mailto:bianca.tomlinson@la-francaise.com)  
<https://www.la-francaise-systematic-am.com>

Heidi Rauen +49 69 339978 13 | [hrauen@dolphinvest.eu](mailto: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-ett-portfolio-global-r/> und <https://www.la-francaise-systematic-am.com/produkte/aktienfonds/details/la-francaise-systematic-ett-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](http://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](mailto:info-am@la-francaise.com), oder an die Verbraucherschlichtungsstelle unter folgender Adresse: [info@ombudsstelle-investmentfonds.de](mailto:info@ombudsstelle-investmentfonds.de)