



LA FRANÇAISE
ASSET MANAGEMENT



HALBJAHRESBERICHT Veri ETF-Dachfonds

vom 01.01.2020 bis 30.06.2020

La Française Asset Management GmbH

La Française Asset Management GmbH
mainBuilding
Taunusanlage 18
60325 Frankfurt am Main

Handelsregister:
Frankfurt HRB 34125

Geschäftsführung:
Aurélie Fouilleron Masson
Hosnia Said
Pascal Traccucci

www.la-francaise-am.de

VERMÖGENSÜBERSICHT

Vermögensübersicht

		Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
I. Vermögensgegenstände		74.719.060,83	100,27
1. Investmentanteile		73.818.682,34	99,06
- Indexfonds	EUR	73.818.682,34	99,06
2. Derivate		-221.908,90	-0,30
- Futures (Verkauf)	EUR	-184.628,98	-0,25
- Futures (Kauf)	EUR	-37.279,92	-0,05
3. Bankguthaben		-256.058,05	-0,34
- Bankguthaben in EUR	EUR	559.343,31	0,75
- Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR	-815.401,36	-1,09
4. Sonstige Vermögensgegenstände		1.378.345,44	1,85
II. Verbindlichkeiten		-203.398,13	-0,27
1. Sonstige Verbindlichkeiten		-203.398,13	-0,27
III. Fondsvermögen	EUR	74.515.662,70	100,00¹⁾

¹⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Investmentanteile							EUR	73.818.682,34	99,06
Gruppenfremde Investmentanteile							EUR	73.818.682,34	99,06
LU1861134382	AMUNDI INDEX MSCI WORLD SRI UCITS ETF DR	ANT		92.898	0	7.561	EUR 56,8900	5.284.967,22	7,09
LU1806495575	AMUNDI INDEX US CORP SRI UCITS ETF DR - USD	ANT		36.852	119.903	90.875	EUR 53,9180	1.986.986,14	2,67
LU1291101555	BNP Easy - MSCI Europe Small Caps SRI S-S 5% Cap	ANT		4.221	4.221	0	EUR 216,5970	914.255,94	1,23
LU1753045415	BNP Paribas Easy - MSCI Eur. SRI S-S. 5% Capped	ANT		170.668	293.409	416.745	EUR 21,6800	3.700.082,24	4,97
LU1659681669	BNP Paribas Easy - MSCI USA SRI S-Series 5% Capped	ANT		423.188	423.188	0	EUR 11,7303	4.964.122,20	6,66
LU1859444769	BNP Paribas Easy Corp Bond SRI Fossil Free UCITS	ANT		137.934	557.135	458.317	EUR 10,5515	1.455.410,60	1,95
LU2008763935	BNP PE- FTSE E/N Developed Europe ex UK Green ETF	ANT		92.298	0	20.389	EUR 8,3183	767.762,45	1,03
LU1753045928	BNPPE MSCI Japan SRI S-S5C	ANT		88.173	88.173	210.502	EUR 20,9129	1.843.953,13	2,47
LU0378449770	ComStage ETF-NASDAQ 100 I	ANT		69.706	45.390	47.417	EUR 92,7700	6.466.625,62	8,68
DE000ETFL177	Deka Deutsche Börse EUROGOV Germany ETF	ANT		16.875	58.834	44.426	EUR 102,3300	1.726.818,75	2,32
IE00B14X4S71	iShares \$ Treasury Bond 1-3yr ETF	ANT		7.209	25.237	19.079	EUR 120,4000	867.963,60	1,16
IE00BJK55C48	iShares EUR High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF	ANT		178.810	178.810	0	EUR 4,7592	850.992,55	1,14
IE00B1TXK627	iShares Global Water UCIT ETF - Water 50	ANT		46.062	0	0	EUR 38,8950	1.791.581,49	2,40
IE00B1FZS798	iShares II \$ Treasury Bond 7-10yr ETF	ANT		4.398	15.450	11.736	EUR 198,7000	873.882,60	1,17
IE00BF553838	iShares II PLC - JP Morgan ESG \$ EM Bond UCITS ETF	ANT		174.911	331.624	197.038	EUR 4,9985	874.292,63	1,17
IE00BYVJRR92	iShares IV - MSCI USA SRI UCITS ETF USD Accumulat.	ANT		811.592	811.592	1.133.151	EUR 7,4670	6.060.157,46	8,13
IE00BYX2JD69	iShares MSCI World SRI UCITS ETF	ANT		593.774	0	1.148.264	EUR 6,4220	3.813.216,63	5,12
IE00B3CNHJ55	L&G Russell 2000 US Small CP	ANT		8.887	34.525	25.638	EUR 53,2200	472.966,14	0,63
LU1563454310	Lyxor Green Bond (DR) UCITS ETF	ANT		51.622	0	0	EUR 54,9860	2.838.487,29	3,81
LU1769088581	Lyxor MSCI EM ESG Trend Leaders UCITS ETF	ANT		147.273	147.273	0	EUR 15,8460	2.333.687,96	3,13
LU1048313891	UBS - MSCI Emerging Markets SR ETF A Dis. USD	ANT		183.595	24.562	0	EUR 10,3760	1.904.981,72	2,56
LU0629460832	UBS - MSCI Pacific Socially Respons. UCITS ETF A	ANT		15.087	15.087	35.478	EUR 61,1200	922.117,44	1,24
LU1484799769	UBS ETF - Bloomberg Barclays MSCI Euro Area Liquid	ANT		571.289	0	134.667	EUR 14,3550	8.200.853,60	11,01
LU0629460089	UBS ETF - MSCI USA Socially Responsible ETF A	ANT		60.875	46.713	7.073	EUR 112,0200	6.819.217,50	9,15
LU0629459743	UBS ETF - MSCI World Socially Respons. UCITS ETF A	ANT		68.344	0	23.885	EUR 89,0100	6.083.299,44	8,16
Summe Wertpapiervermögen ³⁾							EUR	73.818.682,34	99,06

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Derivate							EUR	-221.908,90	-0,30
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)									
Aktienindex-Derivate							EUR	-157.989,51	-0,21
Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	-157.989,51	-0,21
Aktienindex-Terminkontrakte							EUR	-157.989,51	-0,21
E-Mini S&P 500 Index Future 09/20		NAR	USD Anzahl	-4.600				-157.989,51	-0,21
Zins-Derivate							EUR	-26.639,47	-0,04
Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	-26.639,47	-0,04
Zinsterminkontrakte							EUR	-26.639,47	-0,04
6,000% Euro Bobl Future 09/20		EDT	EUR	-2.100.000				-18.060,00	-0,02
6,000% 5-Year U.S. Treasury Notes Future 09/20		NAU	USD	-1.300.000				-8.579,47	-0,01
Devisen-Derivate							EUR	-37.279,92	-0,05
Forderungen/Verbindlichkeiten							EUR	-37.279,92	-0,05
Devisenfutures							EUR	-37.279,92	-0,05
EUR/USD Currency Future 09/20	3,3 Mio.	NAR	STK				USD 1,1254	-37.279,92	-0,05

Vermögensaufstellung zum 30.06.2020

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg.in 1.000	Bestand 30.06.2020	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
Bankguthaben							EUR	559.712,87	0,75
EUR - Guthaben bei:							EUR	559.343,31	0,75
	Société Générale S.A. [Frankfurt Branch] (Verwahrstelle)		EUR	553.448,04	%		100,0000	553.448,04	0,74
Tagesgeld							EUR	5.895,27	0,01
			EUR	5.895,27				5.895,27	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	369,56	0,00
			JPY	44.767,00	%		100,0000	369,56	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	1.378.345,44	1,85
Forderungen aus Anteilsceingeschäften							EUR	1.003,32	0,00
			EUR	1.003,32				1.003,32	0,00
Einschüsse (Initial Margins)							EUR	1.156.057,78	1,55
			EUR	1.156.057,78				1.156.057,78	1,55
Variation Margin							EUR	221.284,34	0,30
			EUR	221.284,34				221.284,34	0,30
Kurzfristige Verbindlichkeiten							EUR	-815.770,92	-1,09
Banksaldo in nicht EU/EWR-Währungen							EUR	-815.770,92	-1,09
			USD	-917.415,97	%		100,0000	-815.770,92	-1,09
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-203.398,13	-0,27
Verbindlichkeiten aus Anteilsceingeschäften							EUR	-85.025,06	-0,11
			EUR	-85.025,06				-85.025,06	-0,11
Kostenabgrenzung							EUR	-118.355,19	-0,16
			EUR	-118.355,19				-118.355,19	-0,16
Zinsverbindlichkeit aus Bankguthaben							EUR	-17,88	0,00
			EUR	-17,88				-17,88	0,00
Fondsvermögen							EUR	74.515.662,70	100,00 ²⁾
Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (P)							EUR	13,150	
Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (I)							EUR	14,500	
Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (W)							EUR	10,630	
Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (P)							STK	5.544.153,309	
Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (I)							STK	111.416,491	
Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (W)							STK	1.832,000	

²⁾ Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

³⁾ Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Devisenkurse (in Mengennotiz)

	per 30.06.2020		
Japanische Yen	(JPY)	121,136300	= 1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,124600	= 1 Euro (EUR)

Marktschlüssel

b) Terminbörse

EDT	EUREX
NAR	Chicago Mercantile Exchange
NAU	Chicago (CBOT)

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

- Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge
Investmentanteile				
Gruppenfremde Investmentanteile				
LU1681044480	AIS - MSCI EM ASIA ETF	ANT	14.596	53.327
LU1659681313	BNPPE - MSCI Emerging SRI S-Series 5% Capped ETF €	ANT	73.742	82.853
IE00B60SX402	Invesco Markets-Russell 2000 UCITS ETF	ANT	0	41.603
IE00B66F4759	iShares - Euro High Yield Corporate Bond ETF	ANT	7.369	8.585
DE000A0D8Q49	iShares DJ U.S. Select Dividend ETF (DE)	ANT	0	16.151
DE0005933998	iShares STOXX Europe Mid 200 ETF (DE)	ANT	0	49.385
IE00B1FZSF77	iShares US Property Yield ETF	ANT	0	36.859
DE000A0Q8NE4	L&G UCITS ETF- Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	ANT	0	43.436
LU1812092168	Lyxor ETF STOXX Europe Select Dividend 30	ANT	0	64.569
LU0292108619	Xtrackers - MSCI EM Latin America Swap UCITS ETF	ANT	16.793	41.583
LU0322253906	Xtrackers - MSCI Europe Small Cap UCITS ETF	ANT	0	51.623

Derivate

(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe / Zugänge	Verkäufe / Abgänge	Volumen in 1.000
Terminkontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte (Basiswerte: E-Mini S&P 500 Index Future EURO STOXX 50 Index Future)	EUR			31.002
Zinsterminkontrakte				
Verkaufte Kontrakte (Basiswerte: 5-Year U.S. Treasury Notes Future Euro Bobl Future)	EUR			8.254
Devisenterminkontrakte				
Devisenfutures				
Gekaufte Kontrakte (Basiswerte: EUR/USD Currency Future)	EUR			13.850

Sondervermögen Veri ETF-Dachfonds

	Veri ETF-Dachfonds (P)	Veri ETF-Dachfonds (I)
Mindestanlagesumme	keine	100.000 EUR
Fondsaufgabe	02.04.2007	16.04.2008
Ausgabeaufschlag	0,00%	0,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%	0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)	1,50%	0,60%
Stückelung	Globalurkunde	Globalurkunde
Ertragsverwendung	Ausschüttend	Ausschüttend
Währung	Euro	Euro
ISIN	DE0005561674	DE000A0MKQL5
		Veri ETF-Dachfonds (W)
Mindestanlagesumme		keine
Fondsaufgabe		02.09.2013
Ausgabeaufschlag		5,00%
Rücknahmeabschlag		0,00%
Verwaltungsvergütung (p.a.)		1,50%
Stückelung		Globalurkunde
Ertragsverwendung		Ausschüttend
Währung		Euro
ISIN		DE000A0MKQH3

ANHANG GEM. § 7 NR. 9 KARBV

Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Während des Berichtszeitraums wurden keine Transaktionen gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

Sonstige Angaben

Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (P)	EUR	13,150
Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (I)	EUR	14,500
Anteilwert Veri ETF-Dachfonds (W)	EUR	10,630
Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (P)	STK	5.544.153,309
Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (I)	STK	111.416,491
Umlaufende Anteile Veri ETF-Dachfonds (W)	STK	1.832,000

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die von der Verwahrstelle übermittelten Bewertungskurse für die einzelnen Wertpapiere bzw. Derivate werden von der La Française Asset Management GmbH als verantwortliche Stelle für die Anteilpreisermittlung mittels unabhängiger Referenzkurse von Informationsdienstleistern wie Bloomberg, Reuters oder Interactive Data stichprobenartig geprüft.

Im Fall von handelbaren Wertpapieren erfolgt die Bewertung zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs. Wertpapiere, für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden im Rahmen eines mehrstufigen Prozesses einer detaillierten Kursprüfung unterzogen, wobei folgende Grundsätze gelten:

- Wertpapiere, für die in Bloomberg kein Kurs bereitgestellt wird, oder deren Kurs länger als 10 Bewertungstage konstant ist, werden als nicht mehr handelbar eingestuft. Die von der Verwahrstelle für diese Wertpapiere gelieferten Kurse werden mittels Quotierungen Dritter oder anhand von Preisen auf Basis von geeigneten Bewertungsmodellen plausibilisiert.
- Ein Wechsel der Kursquelle erfolgt nur bei dauerhafter Verfügbarkeit der neuen Quelle.
- Steht als Kursquelle ausschließlich ein mittels Bewertungsmodell errechneter Preis zur Verfügung, wird dieser Preis anhand eines weiteren unabhängigen Bewertungsmodells verifiziert (Einhaltung des Zwei-Quellen-Prinzips).

Die Bewertung von Investmentanteilen erfolgt grundsätzlich auf Basis des Rücknahmepreises des Vortages oder - sofern kein Rücknahmepreis verfügbar ist - auf Basis von Börsenkursen. Exchange-Traded-Funds werden zum Börsenkurs bewertet.

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Nicht börsengehandelte Derivate (wie z.B. Devisentermingeschäfte oder Swaps) werden mittels marktgängiger Verfahren unter Einbeziehung der relevanten Marktinformationen bewertet.

Bankguthaben und sonstige Vermögensgegenstände sind zum Nennwert bewertet. Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

Frankfurt am Main, Juli 2020
La Française Asset Management GmbH
Die Geschäftsführung

ANGABEN ZUR GESELLSCHAFT

La Française Asset Management GmbH

mainBuilding
Taunusanlage 18
60325 Frankfurt am Main
Tel.: +49 (0) 69. 97 57 43 -0
Fax: +49 (0) 69. 97 57 43 -81
info-am@la-francaise.com
www.la-francaise-am.de

Haftendes Eigenkapital
€ 2,6 Mio., Stand 31.12.2019
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
€ 2,6 Mio., Stand 31.12.2019

Gesellschafter

Veritas Portfolio GmbH & Co. KG,
Frankfurt am Main

Geschäftsführer

Aurélie Fouilleron Masson, 92100 Boulogne, Frankreich
Hosnia Said, 61381 Friedrichsdorf
Pascal Traccucci, 92100 Boulogne, Frankreich

Verwahrstelle

Zweigstelle Frankfurt am Main der
Société Générale S.A., Paris
Neue Mainzer Straße 46-50
60311 Frankfurt am Main
Haftendes Eigenkapital: € 63,1 Mrd.,
Stand 31.12.2019

Wirtschaftsprüfer

FFA Frankfurt Finance Audit GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft,
Frankfurt am Main

Aufsichtsrat

Philippe Verdier
Chief Financial Officer
Group La Française,
Paris
Vorsitzender

Laurent Jacquier-Laforge
Chief Investment Officer Equity
Group La Française,
Paris
Stellvertretender Vorsitzender

Dr. Sybille Hofmann
unabhängige Aufsichtsrätin

Verbandsmitglied bei

BVI Bundesverband
Investment und Asset Management e.V.,
Frankfurt am Main



LA FRANÇAISE
ASSET MANAGEMENT

La Française Asset Management GmbH

mainBuilding
Taunusanlage 18
60325 Frankfurt am Main

Tel.: +49 (0) 69.97 57 43 -0
Fax: +49 (0) 69.97 57 43 -81
info-am@la-francaise.com
www.la-francaise-am.de