



# J. Safra Sarasin

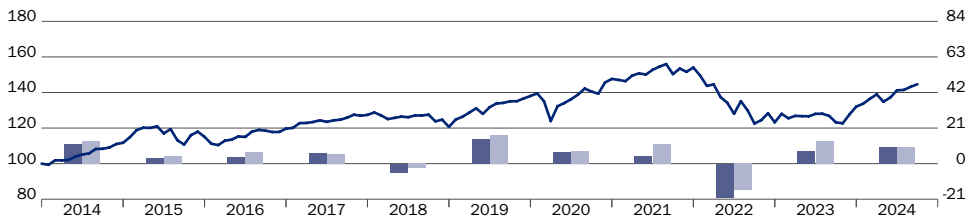
## JSS Sust. Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) P EUR dist

Données au 30 septembre 2024 | Source: JSS Investmentfonds SA | Page 1 de 4

### Portrait du fonds

Le JSS Sustainable Equity - Thematic Balanced (EUR) vise la croissance des actifs à long terme en respectant une répartition optimale des risques. Le fonds investit dans des actions et obligations du monde entier via une approche thématique. Le fonds intégrera systématiquement les considérations ESG ayant une influence financière tout au long du processus d'investissement, afin d'éviter les risques de controverse, d'atténuer les risques ESG et de tirer profit des opportunités. En parallèle, le compartiment peut aussi investir dans des emprunts convertibles ou des emprunts à options, des bons de souscription et des placements similaires, ainsi que conserver des liquidités. Le compartiment est géré activement sans réplication d'un indice de référence. Toutefois, le compartiment est géré en référence à 30% MSCI World NR Index EUR, 20% MSCI World NR Index EUR Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index ("Indice de référence").

### Performance nette (en EUR) au 30.09.2024



échelle de gauche:

— Performance indexée

échelle de droite, la performance annuelle en%:

Fonds ■ Benchmark (BM): Customized ■

	1 Mois	3 Mois	YTD	1 an	3 ans p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.
Fonds	1.04%	2.43%	9.52%	17.38%	-1.28%	1.39%	2.94%
BM	1.20%	3.44%	10.00%	17.94%	3.22%	5.21%	5.71%

	2023	2022	2021	2020	2019	Depuis début
Fonds	7.15%	-19.98%	4.33%	6.96%	14.39%	269.95%
BM	13.52%	-15.49%	11.70%	7.44%	16.56%	553.13%

Les résultats obtenus par le passé n'offrent aucune garantie quant aux rendements futurs. La performance représentée ne tient pas compte de commissions et de coûts éventuels prélevés lors de la souscription et du rachat de parts.

### Les dix principales positions

Apple Inc	3.90%	NVIDIA	2.63%
4.250% Germany 04.07.39	3.37%	2.750% France 25.10.27	2.00%
Amazon Com	3.28%	4.150% Italy 01.10.39	1.92%
Microsoft	3.11%	Zoetis Inc -A-	1.86%
3.250% Spain 30.04.34	2.84%	ASML Holding NV	1.78%

Top 10 positions: 26.69%

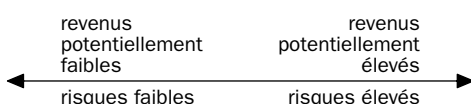
### Asset allocation

Actions	61.69%
Obligations	38.31%

### Répartition des monnaies (including hedging)

EUR	69.02%
USD	23.18%
JPY	2.70%
CHF	2.40%
GBP	1.70%
Übrige	1.00%

### Profil de risque et de rendement



La catégorie de risque et de rendement mentionnée repose sur des données historiques et ne saurait constituer un indicateur fiable du profil de risque futur du Fonds. La classification du Fonds peut évoluer dans le temps et ne saurait être garantie.

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

### Vue globale du fonds

Valeur d'inventaire	410.39
Total des actifs en mio.	62.44
Société d'investissement	J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A.
Dépositaire	CACEIS Investor Service Bank S.A., Luxembourg
Gestion de portefeuille	AM Balanced, Sarasin & Partners LLP, London
Gestionnaire de portefeuille	Phil Collins
Domicile du fonds	Luxembourg
No ISIN	LU0058893917
No valeur suisse	377 951
Bloomberg	SARGDMI LX
Date de lancement de la classe d'action	5 juillet 1995
Date de lanc. du compartiment	5 juillet 1995
Fin de l'exercice	Juin
Frais courants*	1.85%
Frais de gestion	1.50%
Monnaie de compte	EUR
Distribution 2023	EUR 0.00
Dernier distribution	Octobre
Commiss. de souscription	max. 3.00%
Frais de sortie	0.0%
Structure juridique	SICAV
Benchmark (BM)	Customized (Détails voir rapport annuel)
Classification SFDR	Article 8

\*Les frais de gestion du compartiment sont calculés trimestriellement à terme échu et peuvent varier. Des informations détaillées sur ces frais, ainsi que sur les éventuels frais supplémentaires, sont disponibles dans le prospectus / DIC.

### Settlement Details

Souscriptions/rachats	tous les jours
Délai de préavis	n.a.
Règlement subs / reds	T+2 / T+2
Heure limite de réception des ordres (HEC)	12:00
Mécanisme de Swing Pricing	
Investissement minimum de départ	n.a.

Indices statistiques	Fonds	Benchmark
Volatilité	9.79%	9.97%
Bêta	0.95	n.a.
Ratio de Sharpe	-0.38	0.08
Information Ratio	-1.76	n.a.
Tracking Error	2.55%	n.a.

Les indices statistiques sont calculés sur la base des mois précédents (36 mois, base EUR). Taux d'intérêt exempt de risque: 2.40%



# J. Safra Sarasin

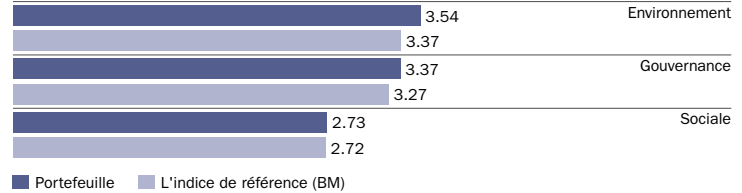
## JSS Sust. Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) P EUR dist

Données au 30 septembre 2024 | Source: JSS Investmentfonds SA | Page 2 de 4

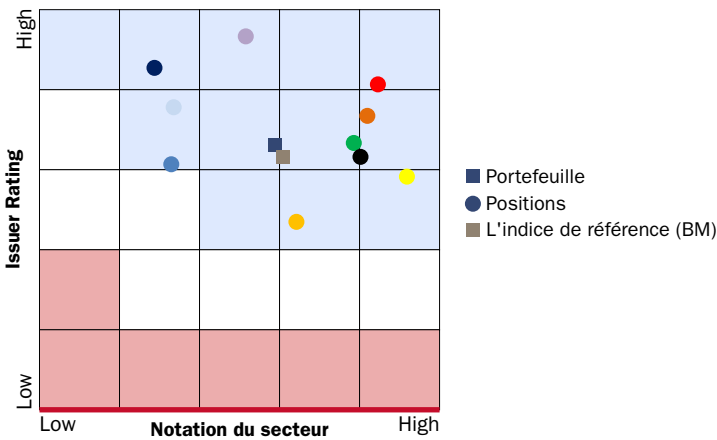
### Approches d'investissement durables

Exclusions (negative screening)	✓
Intégration ESG	✓
Stewardship	✓
Thèmes de durabilité	✓
Objectifs de durabilité	✗

### Scores ESG



### Matrice de durabilité J. Safra Sarasin



- Univers Best-in-Class : Notation JSS ESG A**  
- Profil ESG supérieur à la moyenne, leaders dans leur industrie  
- Eligibles à toutes les stratégies JSS responsables
- Univers neutre : Notation JSS ESG B**  
- Profil ESG moyen, suiveurs dans leur industrie  
- Eligibles aux stratégies JSS d'intégration ESG
- Univers worst-out : Notation JSS ESG C**  
- Profil ESG faible, retardataires dans leur industrie  
- Non éligibles aux stratégies JSS responsables
- Exclusions : Notation JSS ESG D**  
- Activités controversées  
- Non éligibles aux stratégies JSS responsables

### Notations ESG des 10 premières positions

Issuer Name	Pondération	Issuer Rating	Secteur	Notation du secteur
Apple Inc	3.9%	3.1	Matériel informatique, stockage et périphériques	1.6
4.250% Germany 04.07.39	3.4%	4.1	États et régions	4.2
Amazon Com	3.3%	2.3	Broadline Retail	3.2
Microsoft	3.1%	2.9	Logiciel système	4.6
3.250% Spain 30.04.34	2.8%	3.3	États et régions	3.9
NVIDIA	2.6%	4.3	Semi-conducteurs	1.4
2.750% France 25.10.27	2.0%	3.7	États et régions	4.1
4.150% Italy 01.10.39	1.9%	3.2	États et régions	4.0
Zoetis Inc -A-	1.9%	3.8	Médicaments	1.7
ASML Holding NV	1.8%	4.7	Matériaux et équipements semi-conduct.	2.6

### Définitions et explications

**Critères d'exclusion:** Armes controversées (armes biologiques, chimiques et nucléaires, armes à sous-munitions et mines antipersonnel), charbon, OGM dans l'agriculture et la médecine, huile de palme, défense et armement, tabac, divertissement pour adultes, violation des droits de l'homme et autres principes du Pacte mondial des Nations unies.

**Scores ESG:** La notation d'une entreprise représente l'agrégation d'informations plus granulaires analysées selon des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance (sur une échelle de 0 à 5). La comparaison à ce niveau et l'agrégation au niveau du portefeuille donnent des indications plus précises sur l'exposition du portefeuille aux risques liés à la durabilité.

**Matrice de durabilité:** À l'aide de notre méthodologie brevetée, les entreprises et les secteurs sont évalués selon des critères de durabilité (sur une échelle de 0 à 5). Chaque entreprise se retrouve avec un positionnement spécifique dans notre matrice de durabilité, qui met en évidence l'exposition au risque de durabilité d'un secteur donné (notation du secteur) et la capacité relative d'une entreprise à réduire ces risques (notation de l'entreprise).

**Notations ESG des 10 premières positions:** La notation de durabilité de l'entreprise et du secteur (sur une échelle de 0 à 5) des 10 titres ayant la pondération la plus élevée dans le portefeuille est présentée.

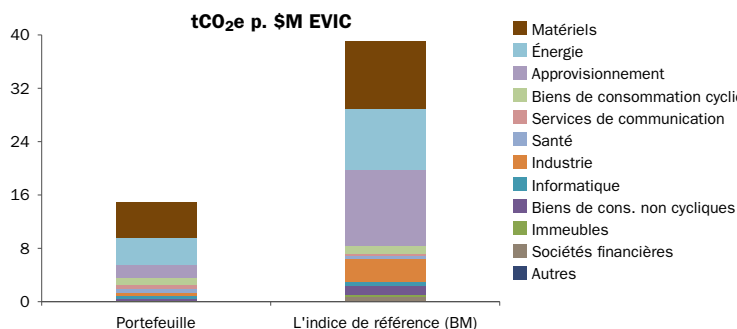


# J. Safra Sarasin

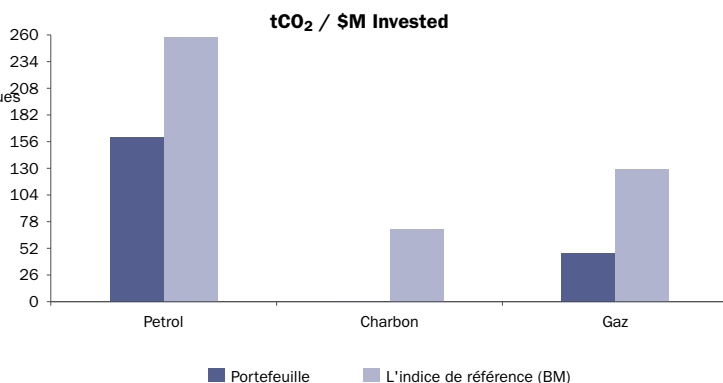
## JSS Sust. Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) P EUR dist

Données au 30 septembre 2024 | Source: JSS Investmentfonds SA | Page 3 de 4

### Empreinte carbone



### Actifs échoués - Emissions CO<sub>2</sub> potentielles



### Plus grands émetteurs de carbone

Entreprise	% de l'empreinte du portefeuille	Mitigation Efforts
OCCIDENTAL PETROLEUM CORPORATION	27.1%	élevés
L'AIR LIQUIDE	18.0%	supérieur à la moyenne
LINDE PUBLIC LIMITED COMPANY - II	17.1%	supérieur à la moyenne
SSE PLC	12.7%	supérieur à la moyenne
AMAZON.COM, INC.	2.8%	supérieur à la moyenne
AMERICA MOVIL, S.A.B. DE C.V.	2.5%	supérieur à la moyenne
TAIWAN SEMICOND. MANUFACT. CO., LTD.	2.3%	supérieur à la moyenne
IHG FINANCE LLC	2.1%	supérieur à la moyenne
DEERE & COMPANY	1.4%	supérieur à la moyenne
VERIZON COMMUNICATIONS INC.	1.2%	supérieur à la moyenne

### Définitions et explications

**Empreinte carbone:** L'empreinte carbone du portefeuille dépend de l'allocation sectorielle et de l'intensité carbone des positions. Réduire l'empreinte carbone par rapport à l'indice de référence tout en préservant un certain équilibre sectoriel permet de réduire les risques associés au sein du portefeuille.

Les empreintes carbone Scope 1 et 2 du portefeuille sont calculées. Elles sont mesurées en tonnes d'équivalent CO<sub>2</sub> par million d'USD de valeur d'entreprise, y compris les liquidités (EVIC).

**Actifs bloqués:** Le graphique montre les émissions futures de CO<sub>2</sub> des réserves de combustibles fossiles détenues par les sociétés du portefeuille par rapport à l'indice de référence. Ces émissions de CO<sub>2</sub> sont mesurées en tonnes d'équivalent CO<sub>2</sub> par million d'USD de valeur d'entreprise y compris les liquidités (EVIC). Les dirigeants mondiaux s'étant accordés sur des limitations des émissions de carbone afin de faire face aux problèmes liés au changement climatique, l'économie doit respecter un budget carbone global. Il en résulte que les actifs carbonés (principalement les réserves de combustibles fossiles) sont en train d'être abandonnés. Les émissions potentielles des réserves de combustibles fossiles donnent un aperçu des risques liés aux actifs bloqués dans le portefeuille.

**Plus grands émetteurs de carbone et leurs efforts de réduction:** Le changement climatique est un facteur de risque important pour l'ensemble de l'économie et donc aussi un axe d'action politique (COP21 / Accord de Paris, Objectif 13 des Nations Unies pour les objectifs du développement durable...). La manière dont les entreprises gèrent leurs émissions de carbone (efforts de diminution) est essentielle pour le succès à long terme de leur activité et de leur écosystème. Les données que nous présentons ci-dessus révèlent l'état de préparation et l'engagement des entreprises face à ce défi.

**SDG Monitor - Part moyenne des revenus liés aux ODD:** Indique la part moyenne des recettes liées aux ODD du portefeuille par rapport à l'indice de référence, cette part étant répartie selon les catégories de revenus liés aux ODD suivants : autonomisation des personnes, capital naturel, transition énergétique et besoins fondamentaux.



# J. Safra Sarasin

## JSS Sust. Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) P EUR dist

Données au 30 septembre 2024 | Source: JSS Investmentfonds SA | Page 4 de 4

### Benchmark Disclaimer

Companies Inc. («S&P») et est sous licence d'utilisation accordée à {titulaire de licence}. Ni MSCI, ni S&P ni aucune autre partie impliquée dans la création ou la compilation de l'indice GICS ou d'une classification GICS quelconque ne donnent aucune garantie expresse ou tacite et ne font aucune déclaration concernant cette norme ou cette classification (ou concernant les résultats que leur utilisation permettrait d'obtenir) et, par la présente, toutes les parties susmentionnées excluent expressément toute garantie quant au caractère original, à l'exactitude, l'exhaustivité, la qualité marchande ou la pertinence de ces normes ou classifications. Sans restreindre ce qui précède, la responsabilité de MSCI, de S&P ou de leurs sociétés affiliées et des tiers impliqués dans la création ou la compilation de l'indice GICS ou d'une classification GICS quelconque ne peut en aucune circonstance être engagée en cas de dommage direct, indirect, particulier, punitif, consécutif ou d'une autre nature (y compris en cas de manque à gagner), même s'ils sont notifiés de la possibilité d'un tel dommage. aptitude à l'emploi de ces normes ou classifications. Sans restreindre ce qui précède, la responsabilité de MSCI, de S&P ou de leurs sociétés affiliées et des tiers impliqués dans la création ou la compilation de l'indice GICS ou d'une classification GICS quelconque ne peut en aucune circonstance être engagée en cas de dommage direct, indirect, particulier, punitif, consécutif ou d'une autre nature (y compris en cas de manque à gagner), même s'ils sont notifiés de la possibilité d'un tel dommage.

### Benchmark Disclaimer

Nous sommes autorisés à citer la source, ICE Data Indices, LLC (ci-après « ICE DATA »). Tant ICE DATA que ses sociétés affiliées et prestataires externes respectifs, déclinent toute responsabilité et s'abstiennent de toute déclaration, explicite ou implicite, quant à de quelconques garanties sur une qualité marchande ou un caractère approprié à une finalité ou à un usage spécifique, y compris pour ce qui concerne les indices, les données relatives aux indices et toute donnée qu'ils contiendraient, qui y seraient liés ou qui en découleraient. Ni ICE DATA, ni ses sociétés affiliées, ni leurs prestataires externes respectifs, ne sauraient être tenus responsables de tout dommage ou conséquence lié à l'exactitude, à la pertinence, à la ponctualité ou à l'exhaustivité des indices, des données relatives aux indices ou de tout élément les composant. Les indices et les données relatives aux indices sont communiqués en l'état, et les utilisateurs en font usage à leurs risques et périls. Ni ICE DATA, ni ses sociétés affiliées, ni leurs prestataires externes respectifs, ne soutiennent, n'appuient ni ne recommandent Banque J. Safra Sarasin SA, ni aucun de ses produits et services.

### Mentions légales - Edition Suisse

Informations destinées aux investisseurs basés en Suisse: La présente publication constitue un document de commercialisation d'un investissement, qui a été préparé uniquement pour l'information et l'usage exclusif de son destinataire en Suisse. Les statuts, ainsi que les rapports annuels et semestriels, le prospectus (tous en allemand ou en anglais) et/ou le document d'information clé (DIC) sont généralement disponibles sans frais (en allemand, en français, en italien, en anglais) auprès de J. Safra Sarasin Investmentfonds AG, Wallstrasse 9, 4002 Bâle, ou en suivant le lien ci-dessous: <https://jsafrasarasin.com/content/jsafrasarasin/language-masters/de/products/funds-list.html> Les déclarations contenues dans le présent document ne peuvent être interprétées comme des conseils en matière d'investissement, de fiscalité ou autres, et ne constituent pas une offre ni une invitation à acheter des parts du Compartiment, et ne remplacent pas les conseils individuels et la communication des informations sur les risques par un conseiller financier, juridique et/ou fiscal qualifié. JSS Investmentfonds SICAV (le «Fonds») est un OPCVM organisé sous la forme d'une société d'investissement à capital variable («SICAV») de droit luxembourgeois, et réglementé par la Commission de Surveillance du Secteur Financier («CSSF»). Ce fonds est un compartiment de JSS Investmentfonds SICAV et a été autorisé à la distribution au public en Suisse par l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers (FINMA). Les investisseurs potentiels doivent consulter le document d'information clé (DIC), le prospectus et tous les documents d'offre locaux pertinents avant de procéder à un investissement et, en particulier, s'informer de façon exhaustive sur les risques associés au Compartiment. Des informations détaillées sur les risques et les avantages associés au Compartiment sont disponibles dans le prospectus ou le DIC des catégories de parts du Compartiment. Les performances passées ne sont pas un indicateur des performances actuelles ou à venir. La performance a été calculée sur la base de la valeur nette d'inventaire et, le cas échéant, du dividende brut réinvesti. Lors du calcul de la performance, tous les frais imputés au Fonds et au Compartiment ont été pris en compte afin d'obtenir une performance nette. La performance indiquée ne comprend pas (le cas échéant) les commissions et les frais encourus par l'investisseur lors de la souscription et du rachat de parts. Les commissions, coûts et taxes supplémentaires encourus par l'investisseur ont un impact négatif sur la performance. Les investissements en devises étrangères impliquent un risque de change dans la mesure où la performance dans la devise de l'investisseur peut être plus ou moins élevée en raison des fluctuations des taux de change. La valeur de l'investissement peut donc, ainsi que pour d'autres raisons, augmenter ou diminuer. Il n'y a donc aucune garantie que l'investisseur récupère le montant total de son capital investi lors du rachat. L'émetteur de la présente fiche signalétique n'est pas en mesure de fournir des informations détaillées sur les commissions ponctuelles ou récurrentes payées à la banque / par la banque et / ou au courtier du fonds / par le courtier du fonds au titre de ce Compartiment. Source des données de performance: J. Safra Sarasin Investmentfonds AG, Datastream et SIX. Toutes les opinions et prévisions sont basées sur les meilleures connaissances disponibles et les convictions de l'émetteur au moment de la publication et peuvent changer sans préavis. Certaines des informations contenues dans cette publication ayant été obtenues auprès de tiers, l'exactitude, l'exhaustivité et la justesse des informations qui y figurent ne peuvent être garanties. La liste des pays dans lesquels le Compartiment est agréé peut être obtenue auprès de J. Safra Sarasin Investmentfonds AG, qui peut décider de mettre fin aux dispositions prises pour la commercialisation du Fonds ou du Compartiment dans un pays donné. Les personnes domiciliées, résidant ou situées aux États-Unis ou de citoyenneté américaine ne sont pas autorisées à détenir des parts du Compartiment et il est interdit d'offrir, d'émettre ou de vendre publiquement de telles parts à des personnes domiciliées, résidant ou situées aux États-Unis ou ayant la citoyenneté américaine. © J. Safra Sarasin