



# J. Safra Sarasin

## JSS Sust. Equity - Systematic Switzerland C CHF dist

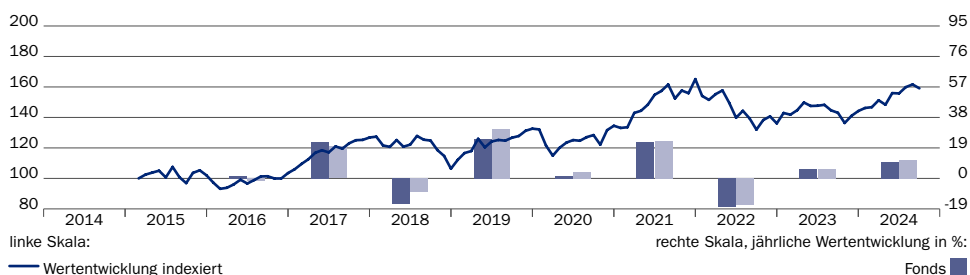


Daten per 30. September 2024 | Quelle: JSS Investmentfonds AG | Seite 1 von 2

### Fondsportrait

Der JSS Sustainable Equity - Systematic Switzerland strebt ein langfristiges Kapitalwachstum an. Der Fonds investiert hierzu vorwiegend in Aktien von Unternehmen, die einen Bezug zur Schweiz haben. Die Titelselektion erfolgt mittels einer regelbasierten Anlagestrategie, welche eine Momentum- und eine Low-Volatility-Strategie kombiniert und hierdurch die Gewichtungen in kleinen, mittleren und grossen Unternehmen definiert.

### Wertentwicklung Netto (in CHF) per 30.09.2024



	1 Monat	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.
Fonds	-1.57%	2.14%	10.34%	11.23%	1.44%	4.66%	n.a.
BM	-1.59%	2.03%	11.47%	13.04%	2.59%	5.83%	n.a.

	2023	2022	2021	2020	2019	Seit Lancierung
Fonds	5.96%	-17.59%	22.75%	1.43%	24.68%	64.81%
BM	6.09%	-16.48%	23.38%	3.82%	30.59%	91.00%

Die Performance der Vergangenheit ist kein Hinweis auf die zukünftig zu erwartende Performance. Bei der Performanceberechnung werden allfällige bei Zeichnung und Rücknahme von Anteilen erhobene Kommissionen und Kosten nicht berücksichtigt.

### Zehn grösste Positionen

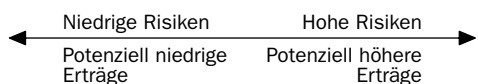
Nestlé N	14.10%	ABB N	4.95%
Novartis N	12.58%	Zurich Financial Services N	4.72%
Roche Holding GS	12.04%	CIE Financiere Richmont	4.55%
JSS Sust Eq - S&M Caps CH	7.17%	Sika LTD	2.85%
UBS Nam.	5.33%	Alcon Inc.	2.67%

Top 10 Positionen: 70.96%

### Aufteilung nach Branchen

34.06%	Gesundheitswesen
16.99%	Finanzen
16.17%	Nichtzykl. Konsumgüter
10.90%	Industrie
7.22%	Fonds
5.83%	Materialien
5.18%	Zyklische Konsumgüter
1.11%	Informationstechn.
0.90%	Kommunikationsdienste
1.64%	Übrige

### Risiko- und Ertragsprofil



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

Die ausgewiesene Risiko- und Ertragskategorie beruht auf historischen Daten und kann nicht als verlässlicher Hinweis auf das künftige Risikoprofil des Fonds herangezogen werden. Die Einstufung des Fonds kann sich im Laufe der Zeit ändern und stellt keine Garantie dar.

### Fondsübersicht

Inventarwert pro Anteil	140.78
Fondsvermögen in Mio.	50.46
Fondsleitung	J. Safra Sarasin Investmentfonds AG, Basel
Depotbank	Bank J. Safra Sarasin AG, Basel
Portfolio Management	AM Equities, Bank J. Safra Sarasin AG, Basel
Portfolio Manager	Mathilde Francini
Fondsdomizil	Schweiz
ISIN-Nr.	CH0245665127
Valoren-Nr.	24 566 512
Bloomberg	SDESCCD SW
Lancierungsdatum	10. Februar 2015
Anteilsklasse	
Lancierungsdatum	5. Dezember 2003
Teilfonds	
Abschluss Rechnungsjahr	August
Laufende Kosten*	1.06%
Verwaltungsgebühr	0.85%
Referenzwährung	CHF
Ausschüttung 2023	CHF 2.00
Letzte Ausschüttung	Dezember
Verkaufsgebühr	max. 3.00%
Rücknahmegebühr	0.0%
Ausgabeaufschlag/ Rücknahmeabschlag zugunsten des Fonds	0.10%
Rechtsform	FCP
Benchmark (BM)	SPI®

\*Die Kosten für die Verwaltung des Teilfonds werden vierteljährlich im Nachhinein berechnet und können variieren. Detaillierte Informationen über diese Kosten, und allfälliger zusätzlicher Kosten können dem Verkaufsprospekt / KID entnommen werden.

### Settlement Details

Zeichnungen/Rücknahmen	täglich
Kündigungsfrist	n.a.
Abwicklung subs / reds	T+2 / T+2
Orderannahmeschluss (MEZ)	12:00
Mindestestanlagebetrag	n.a.
Verwässerungsausgl. Zuschlag/Abzug	0.10 / 0.10

### Statistische Kennzahlen

	Fonds	Benchmark
Volatilität	11.75%	12.47%
Beta	0.93	n.a.
Sharpe Ratio	0.07	0.15
Information Ratio	-0.53	n.a.
Tracking Error	2.15%	n.a.

Die statistischen Kennzahlen werden auf der Basis der Vormonate berechnet (36 Monate, Basis CHF). Risikofreier Zinssatz: 0.66%



# J. Safra Sarasin

## JSS Sust. Equity - Systematic Switzerland C CHF dist

Daten per 30. September 2024 | Quelle: JSS Investmentfonds AG | Seite 2 von 2

### Rückblick

Im September blieb der Schweizer Aktienmarkt mit einem Minus von 1.6% auf CHF-Basis hinter den europäischen Aktienmärkten zurück. Schweizer Aktien entwickelten sich zu Monatsbeginn negativ und haben sich im restlichen Monatsverlauf langsam erholt. Sie beendeten den Monat aber dennoch mit einem Minus, wobei die Schweizerische Nationalbank die Zinsen zu Monatsende um 25 Bp senkte. Grösster Belastungsfaktor war die Minderrendite von Large Caps (-2.0%), wohingegen Small und Mid Caps (+0.58%) stärker abschnitten. Zyklische Sektoren schnitten überdurchschnittlich ab, allen vor Grundstoffe (+3.0%), Kommunikationsdienste (+2.7%) und Finanzen (+2.1%). Basiskonsumgüter (-5.9%), Versorger (-4.4%) und Gesundheit (-3.9%) gerieten indes ins Hintertreffen. Im Monat liess die Strategie ihren Referenzindex leicht hinter sich. Da das Modell der Strategie nach wie vor ein neutrales Signal sendet, behielt sie eine im Vergleich zum Referenzindex neutrale Positionierung bei. Da die UBS mittlerweile ein Rating von A aufweist, wurde sie nun ins Portfolio aufgenommen.

### Ausblick

Aufgrund des rein quantitativen Anlageprozesses haben diskretionäre Einschätzungen der Entwicklung individueller Titel oder Markttrends keine Auswirkungen auf die gegenwärtige und künftige Portfoliozusammensetzung. Die Anlagepolitik wird aus einem dreistufigen Markttrendfilter, einem Mid-Cap-Momentum-Modell und einem Large-Cap-Low-Volatility-Modell abgeleitet. Das langfristige Ertragspotenzial des JSS Sustainable Equity – Systematic Switzerland wird somit von der Fähigkeit dieser drei Modelle bestimmt, sich an das vorherrschende Marktumfeld anzupassen. Zum Zeitpunkt der Erstellung des Berichts signalisierte unser Indikator wieder ein neutrales Umfeld. In der letzten Augustwoche hatte er auf eine risikoaverse Position gewechselt. Die Fondspositionierung wurde auf ein neutrales Engagement mit einer am Referenzindex angelehnten Allokation und Titelauswahl umgestellt.

### Benchmark Disclaimer

«Swiss Exchange AG («SIX Swiss Exchange») ist die Quelle der SMI Indices® ] und der darin enthaltenen Daten. SIX Swiss Exchange war in keinerlei Form an der Erstellung der in dieser Berichterstattung enthaltenen Informationen beteiligt. SIX Swiss Exchange übernimmt keinerlei Gewährleistung und schliesst jegliche Haftung (sowohl aus fahrlässigem sowie aus anderem Verhalten) in Bezug auf die in dieser Berichterstattung enthaltenen Informationen – wie unter anderem für die Genauigkeit, Angemessenheit, Richtigkeit, Vollständigkeit, Rechtzeitigkeit und Eignung für beliebige Zwecke – sowie hinsichtlich Fehlern, Auslassungen oder Unterbrechungen in den SMI Indices® oder dessen Daten aus. Jegliche Verbreitung oder Weitergabe der von SIX Swiss Exchange stammenden Informationen ist untersagt.»

### Rechtliche Hinweise - Ausgabe Schweiz:

Informationen für Anleger in der Schweiz: Bei dieser Publikation handelt es sich um Marketingmaterial für einen Fonds, das ausschliesslich zu Informationszwecken und zur alleinigen Verwendung durch den Empfänger in der Schweiz erstellt wurde. Der aktuelle Fondsprospekt und Fondsvertrag (jeweils in deutscher oder englischer Sprache) und/oder das Basisinformationsblatt (Key Information Document, KID) sind im Allgemeinen (auf Deutsch, Französisch, Italienisch und Englisch) kostenfrei bei der Depotbank und der Informationsstelle (Bank J. Safra Sarasin AG, Elisabethenstrasse 62, CH-4051 Basel, Schweiz) und der Fondsleitung (J. Safra Sarasin Investmentfonds AG, Wallstrasse 9, CH-4002 Basel, Schweiz) erhältlich oder unter <https://product.jsafrasarasin.com/internet/product/en/index>

Die Aussagen in dieser Publikation sind weder als Anlage-, Steuer- oder sonstige Beratung auszulegen noch stellen sie ein Angebot oder eine Aufforderung zum Kauf von Anteilen des Subfonds dar und ersetzen auch nicht die individuelle Beratung und Risikoaufklärung durch einen qualifizierten Finanz-, Recht- und/oder Steuerberater. Der Fonds ist ein vertraglicher Fonds schweizerischen Rechts des Typs "andere Fonds für traditionelle Anlagen", welcher durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht Finanzmarktaufsicht („FINMA“) beaufsichtigt wird.

Dieser Fonds ist ein vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts. Potenzielle Anleger sollten das Basisinformationsblatt (Key Investor Document, KID), den Prospekt sowie alle rechtlich relevanten lokalen Angebotsunterlagen lesen, bevor sie eine Anlage tätigen, und sich insbesondere umfassend über die mit dem Fonds verbundenen Risiken informieren. Ausführliche Informationen in Bezug auf die Risiken und Vorteile finden sich im Fondsprospekt, Fondsvertrag oder KID des Fonds. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Hinweis auf die aktuelle oder zukünftige Wertentwicklung.

Die Wertentwicklung wurde auf Grundlage des Nettoinventarwerts und, falls zutreffend, der reinvestierten Bruttodividende berechnet. Bei der Berechnung der Wertentwicklung wurden sämtliche, vom Fonds zu zahlenden Gebühren berücksichtigt, um eine Netto-Wertentwicklung zu errechnen. In der ausgewiesenen Wertentwicklung sind Provisionen und Kosten, die auf Anlegerebene bei der Zeichnung und Rücknahme von Anteilen anfallen (sofern zutreffend), nicht berücksichtigt. Zusätzliche Provisionen, Kosten und Steuern, die auf Anlegerebene anfallen, wirken sich negativ auf die Wertentwicklung aus.

Anlagen in Fremdwährungen sind mit einem Währungsrisiko verbunden, da der Ertrag in der Währung des Anlegers aufgrund von Wechselkursschwankungen höher oder niedriger ausfallen kann. Der Wert der Beteiligung des Anlegers kann daher sowie aus anderen Gründen steigen oder fallen. Es kann somit nicht garantiert werden, dass Anleger bei Rücknahme ihr gesamtes investiertes Kapital zurückerhalten.

Der Herausgeber dieses Factsheets ist nicht in der Lage, Angaben zu einmaligen oder wiederkehrenden Provisionen zu machen, die an die Bank / von der Bank und/oder an den Fondsmakler / vom Fondsmakler im Zusammenhang mit diesem Fonds zu zahlen sind. Quelle der Daten zur Wertentwicklung: J. Safra Sarasin Investmentfonds AG, Datastream und SIX. Sämtliche Ansichten und Prognosen beruhen auf dem besten Wissen und Gewissen des Herausgebers zum Zeitpunkt der Veröffentlichung und können sich ohne vorherige Ankündigung ändern. Da einige der in dieser Publikation enthaltenen Informationen von Drittparteien stammen, kann die Genauigkeit, Vollständigkeit und Korrektheit der in dieser Publikation enthaltenen Informationen nicht garantiert werden. Die Liste der Länder, in denen der Fonds registriert ist, kann von J. Safra Sarasin Investmentfonds AG bezogen werden, die beschliessen kann, die für den Vertrieb des Fonds in einem Land getroffenen Vereinbarungen zu beenden. Personen, die ihren Wohnsitz, Sitz oder Aufenthaltsort in den USA haben oder die US-Staatsbürgerschaft besitzen, dürfen keine Anteile des Fonds halten. Ausserdem ist es untersagt, diesen Personen Anteile des Fonds öffentlich anzubieten, auszugeben oder zu verkaufen. © J. Safra Sarasin