



JSS Sust. Multi Asset - Global Income P CHF H2 acc

Août 2022 | Page 1 de 4



Vue globale du fonds

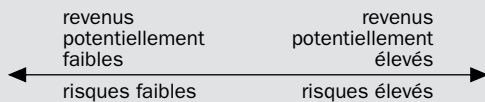
Valeur d'inventaire	100.30
Total des actifs en mio.	23.25
Société d'investissement	J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A.
Dépositaire	RBC Investor Services Bank S.A., Luxembourg
Gestion de portefeuille	
Gestionnaire de portefeuille	Auréli Tixerand
Domicile du fonds	Luxembourg
No ISIN	LU1280137339
No valeur suisse	29 316 599
Lancement	13 novembre 2015
Fin de l'exercice	Avril
Frais courants	1.78%
Frais de gestion	1.25%
Monnaie de compte	CHF
Distribution	Aucune (réinvestissant)
Commission de souscription	max. 3.00%
Frais de sortie	0.0%
Structure juridique	SICAV
Émission/rachat	tous les jours
Benchmark (BM)	Pas de benchmark représentatif disponible
Classification SFDR	Article 8

Indices statistiques

Indices statistiques	Fonds
Volatilité	8.21%
Corrélation	n.a.
Bêta	n.a.
Ratio de Sharpe	0.20
Information Ratio	n.a.
Jensens Alpha	n.a.
Alpha	n.a.
Tracking Error	n.a.

Les indices statistiques sont calculés sur la base des mois précédents (36 mois, base CHF). Taux d'intérêt exempt de risque: -0.75%

Profil de risque et de rendement



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

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.

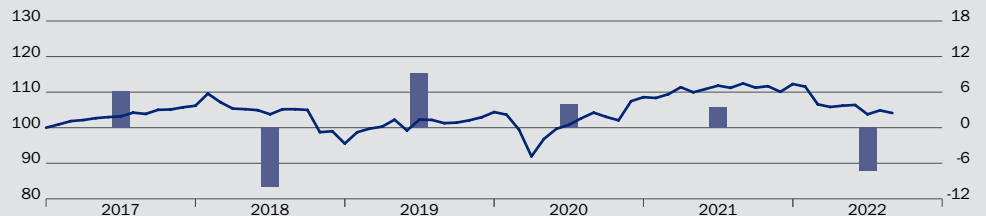
L'attention des investisseurs est attirée sur le fait que JSS Sustainable Multi Asset - Global Income présente, au regard des attentes de l'Autorité des Marchés Financiers, une communication disproportionnée sur la prise en compte des critères extra-financiers dans sa gestion.

Portrait du fonds

Le JSS Sustainable Multi Asset - Global Income (anciennement JSS Global Allocation) se focalise sur les actifs générateurs de revenus, les coupons et des dividendes contribuant fortement au rendement total. Le fonds investit globalement dans toutes les classes d'actifs avec une approche flexible et sans contraintes.

Le compartiment vise à bénéficier de nombreuses opportunités d'investissement dans des classes d'actifs mondiales liquides, tout en diversifiant le risque entre les régions, les secteurs et les émetteurs. 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. L'allocation flexible des actifs vise à obtenir des primes de risque de marché à long terme et à atténuer les risques de perte grâce à une construction de portefeuille axée sur l'optimisation du profil risque/rendement.

Performance nette (en CHF) au 31.08.2022



échelle de gauche:

— Performance indexée

échelle de droite, la performance annuelle en%:

Fonds ■

	1 Mois	3 Mois	YTD	1 an	3 ans p.a.	5 ans p.a.
Fonds	-0.71%	-2.14%	-7.27%	-7.40%	0.93%	0.05%
BM	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.

	2021	2020	2019	2018	2017	Depuis début
Fonds	3.40%	4.02%	9.26%	-10.01%	6.18%	0.30%
BM	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.

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

2.875% USA 15.05.52	4.85%
2.500% US Treasury 15.05.24	4.13%
1.750% Australia 21.06.31	2.58%
1.250% Australia 21.05.32	2.51%
3.908% DP World Cres Ltd. 31.05.23	1.26%
2.875% Sausi Arabian Oil 16.04.24	1.24%
3.375% REC Ltd 25.07.24	1.22%
3.375% CN state Constr. 29.11.22	1.22%
1.500% Hero Asia Inv Ltd 18.11.23	1.21%
1.625% CICC HK Finance 26.01.24	1.21%

Asset allocation

67.70%	Obligations
16.80%	Actions
15.50%	Liqu.(incl.infl.ofDeriv)

Répartition des monnaies (including hedging)

92.10%	USD
3.50%	EUR
2.60%	Übrige
1.40%	CHF
0.40%	GBP



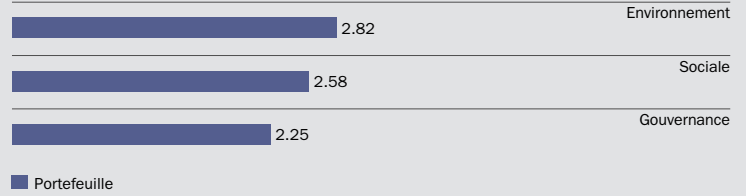
JSS Sust. Multi Asset - Global Income P CHF H2 acc

Août 2022 | Page 2 de 4

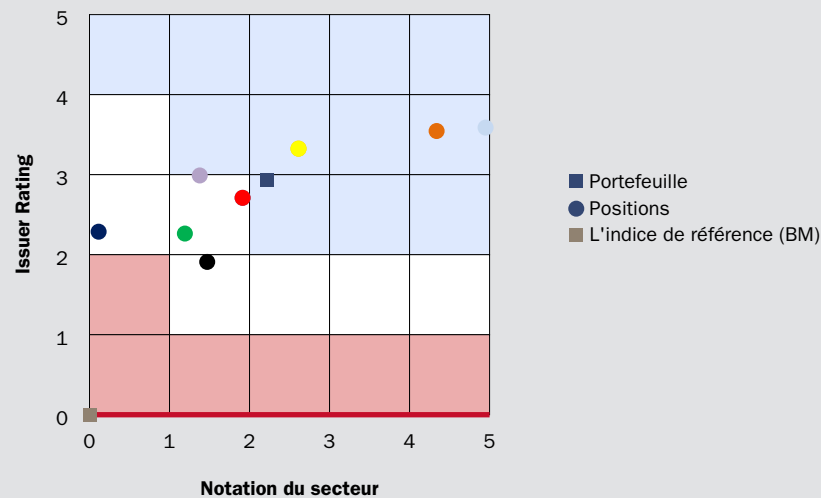
Approches d'investissement durables

Exclusions (negative screening)	✓
Best-in-Class (positive screening)	✗
Intégration ESG	✓
Actionnariat Actif	✓
Thèmes de durabilité	✗
Objectifs de durabilité	✗

Scores ESG



Matrice de durabilité J. Safra Sarasin



Notations ESG des 10 premières positions

Issuer Name	Pondération	Issuer Rating	Secteur	Notation du secteur
2.875% USA 15.05.52	4.9%	2.7	États et régions	1.9
2.500% US Treasury 15.05.24	4.1%	2.7	États et régions	1.9
1.750% Australia 21.06.31	2.6%	3.3	États et régions	2.6
1.250% Australia 21.05.32	2.5%	3.3	États et régions	2.6
3.908% DP World Cres Ltd. 31.05.23	1.3%	2.3	Ports et services maritimes	1.2
2.875% Sausi Arabian Oil 16.04.24	1.2%	2.3	Pétrole et gaz intégrés	0.1
3.375% REC Ltd 25.07.24	1.2%	3.5	Finance spécialisée	4.3
3.375% CN state Constr. 29.11.22	1.2%	1.9	Ingénierie de construction	1.5
1.500% Hero Asia Inv Ltd 18.11.23	1.2%	3.6	Électricité renouvelable	5.0
1.625% CICC HK Finance 26.01.24	1.2%	3.0	Banque d'investissement et courtage	1.4

Definitions and Explanations

Critères d'exclusion: Divertissements pour adultes, violations des droits de l'homme, mines terrestres, armes à sous-munitions, armes nucléaires, défense et armement, énergie nucléaire, charbon, OGM dans l'agriculture et la médecine, tabac.

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).

Nos fonds d'investissement durable sont classés soit comme « enhanced », auquel cas ils visent à investir uniquement dans des entreprises notées A, soit comme « integrated », auquel cas ils visent à investir uniquement dans des entreprises notées A ou B, mais intègrent des critères ESG dans leur processus d'investissement.

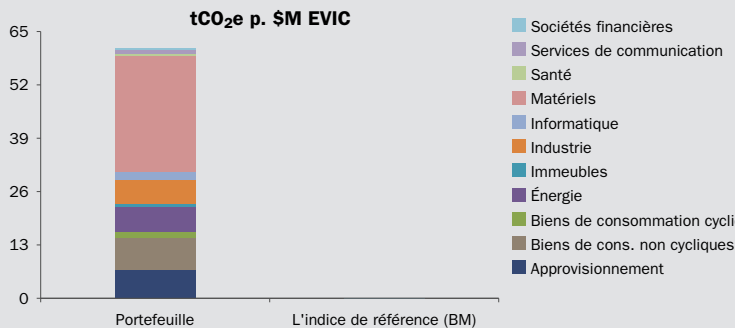
Notations ESG des 10 premières positions: La notation de durabilité de l'entreprise et du secteur (sur une échelle de 0 à 5) des 10 titres ayant la pondération la plus élevée dans le portefeuille est présentée.



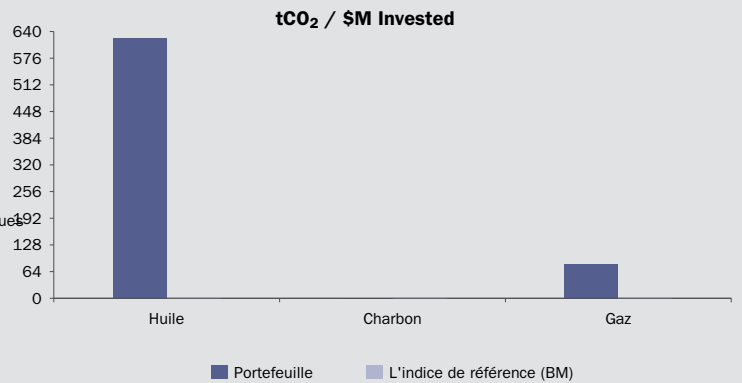
JSS Sust. Multi Asset - Global Income P CHF H2 acc

Août 2022 | Page 3 de 4

Empreinte carbone



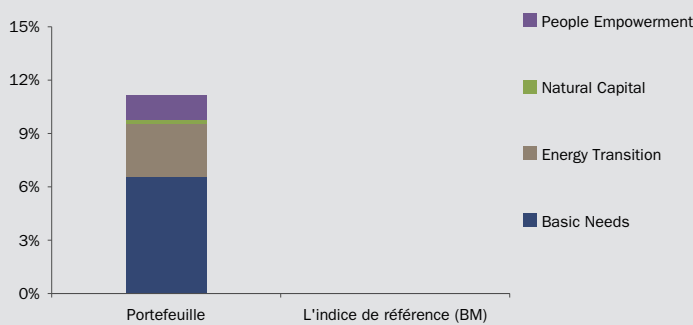
Actifs bloqués - Emissions CO₂ potentielles



Largest CO₂ Emitters

Entreprise	% of Portfolio Footprint	Mitigation Efforts
POSCO HOLDINGS INC.	41.4%	moyenne
HERO ASIA INVESTMENT LIMITED	10.2%	moyenne
BHARAT PETROLEUM CORPORATION LIMITED	5.7%	supérieur à la moyenne
CENCOSUD S.A.	3.8%	inférieur à la moyenne
COSAN S.A.	2.9%	moyenne
UPM-KYMMENE OYJ	2.8%	supérieur à la moyenne
GOLD FIELDS OROGEN HOLDINGS (BVI) LIMITED	2.7%	moyenne
PT JAPFA COMFEED INDONESIA TBK	2.5%	inférieur à la moyenne
UNITED PARCEL SERVICE, INC.	2.3%	supérieur à la moyenne
CHINA STATE CONSTR FINANCE (CAYMAN) II LTD	2.3%	supérieur à la moyenne

SDG Monitor - Average share of SDG Revenues



Definitions and Explanations

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 CO₂ par million d'USD de valeur d'entreprise, y compris les liquidités (EVIC).

Actifs bloqués: Le graphique montre les émissions futures de CO₂ des réserves de combustibles fossiles détenues par les sociétés du portefeuille par rapport à l'indice de référence. Ces émissions de CO₂ sont mesurées en tonnes d'équivalent CO₂ 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.



JSS Sust. Multi Asset - Global Income P CHF H2 acc

Août 2022 | Page 4 de 4



Logo Disclaimer:

«Le Logo du Code de Transparence ISR européen signifie que la Banque J. Safra Sarasin SA s'engage à fournir des informations exactes, adéquates et en temps voulu, pour permettre aux parties prenantes, notamment les consommateurs, de comprendre les politiques et pratiques d'Investissement Socialement Responsable (ISR) du fonds. Une information détaillée sur le Code de Transparence est disponible sur www.eurosif.org, et des informations sur les politiques et pratiques ISR de JSS Sust. Multi Asset - Global Income sont disponibles sur <https://product.jsafrasarasin.com/>. Le Code de Transparence est géré par Eurosif, une organisation indépendante. Le Logo du Code de Transparence ISR européen reflète l'engagement du gestionnaire de fonds tel que décrit ci-dessus et ne doit pas être perçu comme un soutien à une quelconque société, organisation ou individu.»

Mentions légales - Edition France JSS Investmentfonds II SICAV est un OPCVM de droit luxembourgeois organisé sous forme de Société d'Investissement à Capital Variable (« SICAV »), et réglementé par la Commission de Surveillance du Secteur Financier (« CSSF »). Le fonds est un compartiment de JSS Investmentfonds II SICAV. Il a été autorisé pour la vente au public en France par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF). L'émetteur de cette fiche d'information n'est pas en mesure de fournir des détails sur les commissions ponctuelles et/ou récurrentes payées ou reçues par la banque et/ou l'intermédiaire (le broker du fonds) en rapport avec ce produit. Source des chiffres de performance: J. Safra Sarasin Investmentfonds SA, Datastream et SIX. La performance a été calculée sur la base des valeurs nettes d'inventaire (VNI) et des dividendes bruts réinvestis. Lors du calcul de la performance, tous les coûts imputés au fonds ont été inclus pour donner la performance nette. La performance présentée ne tient pas compte des commissions et frais prélevés au niveau de l'investisseur lors de la souscription et du rachat de parts. Les commissions supplémentaires, frais et taxes facturés à l'investisseur ont un effet négatif sur les performances. Les déclarations contenues dans ce document ne constituent ni une offre, ni une invitation à acheter des parts du fonds. Toutes les données sont fournies à des fins informatives et publicitaires seulement et ne doivent pas être interprétées comme étant des conseils en investissement. La dernière version du prospectus, le document d'information clé pour l'investisseur (« DICI »), les statuts ainsi que les rapports annuel et semi-annuel sont disponibles gratuitement auprès du correspondant centralisateur, CACEIS Bank France, 1-3, Place Valhubert, F-75013 Paris. Le dernier prospectus disponible, et plus particulièrement sa section sur les facteurs de risque, ainsi que le DICI doivent être consultés avant d'envisager tout investissement. Toutes les opinions et estimations proviennent d'informations considérées comme étant les plus fiables possibles au moment de la publication, et sont susceptibles d'être modifiées sans préavis. Dans la mesure où les informations contenues dans le présent document viennent en partie de sources tierces, la précision, l'exhaustivité ou l'exactitude des informations contenues dans la présente publication ne peuvent être garanties. Les personnes domiciliées aux Etats-Unis ou les ressortissants américains ne sont pas autorisés à détenir des parts de JSS Investmentfonds II SICAV, et les parts de JSS Investmentfonds II SICAV ne peuvent être vendues, offertes ou émises publiquement à toute personne résidant aux Etats-Unis ou à tout ressortissant américain. Cette publication est destinée uniquement aux investisseurs en France. La performance passée n'est pas un indicateur fiable des performances futures. La valeur de votre investissement peut aussi bien diminuer qu'augmenter. Le retour sur investissement sera donc nécessairement variable. Par conséquent, il n'existe aucune garantie que les investisseurs récupéreront le montant total de leur capital investi au moment du rachat. Les placements en monnaies étrangères peuvent entraîner un risque de change, car le rendement exprimé dans la monnaie de référence de l'investisseur peut être inférieur ou supérieur à la suite des fluctuations des devises.