

| | | | | | | |
|--|---|---|---|---------------------------------------|---|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| Risque/rendement potentiel plus faible pas sans risque | | | | Risque/rendement potentiel plus élevé | | |

JPMorgan Investment Funds - Global Income Fund

Classe: JPM Global Income C (div) - USD (hedged)

Vue globale du fonds

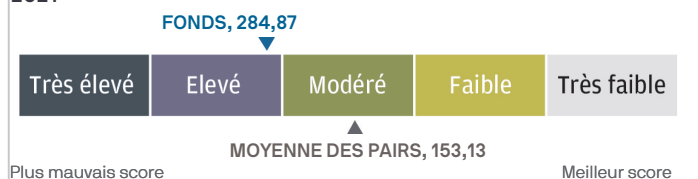
| | | |
|---|---|---|
| ISIN LU1002459144 | Bloomberg JPGICHU LX | Reuters LU1002459144.LUF |
| Objectif d'investissement: Offrir un revenu régulier en investissant, à l'échelle mondiale, essentiellement dans un portefeuille de titres générateurs de revenus et en ayant recours aux instruments dérivés. | | |
| Approche d'investissement | | |
| <ul style="list-style-type: none"> Approche multi-actifs, qui repose sur l'expertise des spécialistes de la plateforme d'investissement mondiale de JPMorgan Asset Management et vise à générer des revenus ajustés du risque. Mise en œuvre flexible des opinions des gérants à l'échelon des classes d'actifs et des régions. | | |
| Gérant(s) de portefeuille Michael Schoenhaut Eric Bernbaum Gary Herbert | Monnaie de référence du fonds EUR | Lancement de la classe 11 Déc. 2013 |
| Spécialiste(s) de l'investissement Mark S Jackson Olivia Mayell Jakob Tanzmeister | Devise de la catégorie de parts USD | Domicile Luxembourg |
| | Actifs net du fonds EUR 22734,5m | Date d'agrément AMF 10 Mars 2009 |
| | VL USD 141,80 | Droits d'entrée / de sortie Droits d'entrée (max) 0,00% Droits de sortie (max) 0,00% |
| | Lancement du fonds 11 Déc. 2008 | Frais courants 0,76% |

Informations sur les facteurs ESG

Approche ESG - Intégration
Ce fonds prend en compte les facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) financièrement significatifs dans son analyse et ses décisions en matière d'investissement, dans le but d'améliorer ses rendements financiers ajustés du risque à long terme.

Risque carbone MSCI ESG

Tonnes CO2e/ventes en Mio USD ; Scope 1 + 2 au 30 septembre 2021



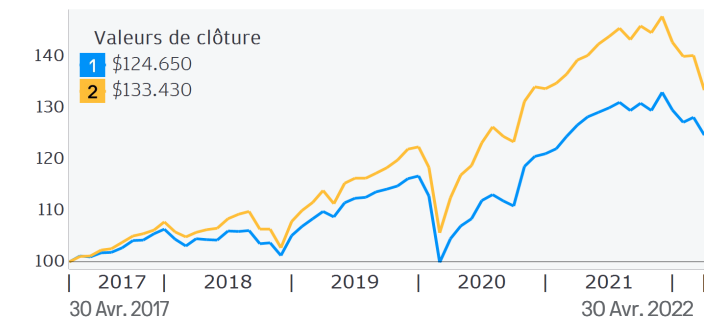
Notations du fonds au 31 mars 2022

Catégorie Morningstar™ Allocation USD Modérée

Performances

- 1 Classe:** JPM Global Income C (div) - USD (hedged)
Indice de référence: 40% Bloomberg Barclays US High Yield 2% Issuer Cap Index (Total Return Gross) Hedged to USD / 35% MSCI World Index (Total Return Net) Hedged to USD / 25% Bloomberg Barclays Global Credit Index (Total Return Gross) Hedged to USD
- 2**

Croissance de 100 000 eur Années civiles



Performances par année civile (%)

| | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 |
|---|------|------|------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|
| 1 | - | - | 7,24 | 0,22 | 7,37 | 9,35 | -3,97 | 14,77 | 3,72 | 10,33 |
| 2 | - | - | 6,05 | -1,03 | 11,99 | 11,04 | -3,23 | 18,62 | 9,97 | 10,19 |

Performances (%)

| | Cumule | | | Annualisés | | |
|---|--------|--------|-------|------------|-------|-----------|
| | 1 mois | 3 mois | 1 an | 3 ans | 5 ans | Lancement |
| 1 | -2,73 | -3,77 | -1,54 | 4,32 | 4,51 | 4,91 |
| 2 | -4,77 | -6,48 | -4,21 | 5,43 | 5,94 | 6,21 |

Informations importantes

Les performances passées ne constituent pas une indication des performances actuelles et futures. La valeur de vos investissements et du revenu qui en découle peuvent évoluer à la hausse comme à la baisse, et vous pouvez ne pas récupérer la totalité du montant initialement investi.

ESG

Pour de plus amples informations sur l'intégration des facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) et sur notre approche de l'investissement durable chez J.P. Morgan Asset Management, rendez-vous sur le site

<https://am.jpmorgan.com/fr/esg>

Historique des dividendes

| Montant | Date d'enregistrement | Date de paiement | Rendement trimestriel | Rendement annuel |
|----------|-----------------------|------------------|-----------------------|------------------|
| \$1,5500 | 08 Fév. 2021 | 19 Fév. 2021 | 1,06 % | 4,33 % |
| \$1,5500 | 07 Mai 2021 | 21 Mai 2021 | 1,03 % | 4,19 % |
| \$1,4700 | 09 Août 2021 | 20 Août 2021 | 0,97 % | 3,94 % |
| \$1,5900 | 08 Nov. 2021 | 19 Nov. 2021 | 1,05 % | 4,25 % |
| \$1,5600 | 07 Fév. 2022 | 18 Fév. 2022 | 1,06 % | 4,32 % |

Analyse du portefeuille

| Mesure | 3 ans | 5 ans |
|-------------------------|-------|-------|
| Bêta | 0,91 | 0,89 |
| Volatilité annuelle (%) | 9,50 | 7,94 |
| Ratio de Sharpe | 0,56 | 0,54 |

Positions *au 31 mars 2022*

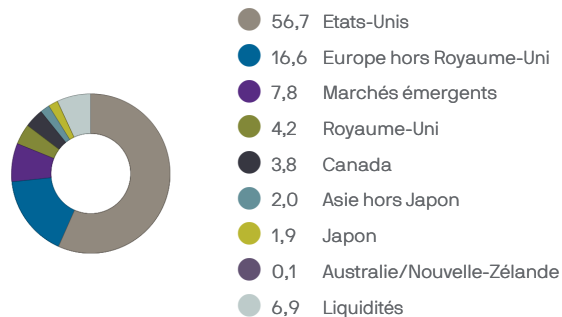
| 10 principales positions | Secteur | % des actifs |
|--|---------|--------------|
| Russell 2000 Covered Call Note 05/2022 | Actions | 1,1 |
| Russell 2000 Covered Call Note 05/2022 | Actions | 1,1 |
| Russell 2000 Covered Call Note 05/2022 | Actions | 1,0 |
| Russell 2000 Covered Call Note 04/2022 | Actions | 1,0 |
| Roche | Actions | 0,5 |
| Nestle | Actions | 0,5 |
| Taiwan Semiconductor | Actions | 0,5 |
| Samsung Electronics | Actions | 0,4 |
| Prologis | Actions | 0,4 |
| Johnson & Johnson | Actions | 0,4 |

Répartition par qualité des obligations (%)

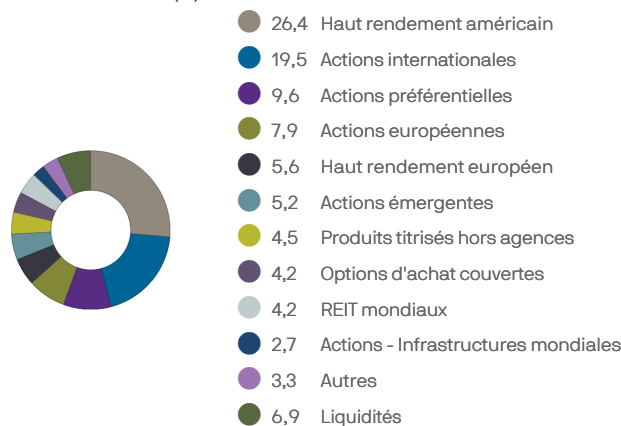
| | |
|----------------|---------------------------|
| AAA: 4,0% | Duration moyenne: 2,8 ans |
| AA: 0,3% | |
| A: 0,9% | |
| BBB: 16,0% | |
| < BBB: 74,9% | |
| Non noté: 3,9% | |

| Valeur en Risque (VaR) | Compartiment | Indice de référence |
|------------------------|--------------|---------------------|
| VaR | 4,72% | 4,67% |

Régions (%)



Allocation d'actifs (%)



Risques principaux

Le Compartiment est exposé aux **Risques d'investissement** ainsi qu'aux **Autres risques liés** découlant des techniques et des titres auxquels il recourt pour atteindre son objectif. Le tableau à droite présente les interrelations entre ces risques et les **Conséquences pour les actionnaires** susceptibles de résulter d'un investissement dans le Compartiment.

Il est également recommandé aux investisseurs de lire la section [Description des risques](#) du Prospectus pour une description complète de chaque risque.

Risques d'investissement Risques liés aux titres et aux techniques du Compartiment

| Techniques | Titres | |
|----------------------|--|--------------------------|
| Produits dérivés | Chine | - Dette investment grade |
| Couverture de risque | Obligations convertibles contingentes | - Dette non notée |
| | Titres convertibles | Marchés émergents |
| | Titres de créance | Actions |
| | - Dette de catégorie inférieure à investment grade | MBS/ABS |
| | - Emprunts d'Etat | REIT |

Autres risques liés Autres risques auxquels le Compartiment est exposé du fait du recours aux techniques et aux titres susmentionnés

| Crédit | Taux d'intérêt | Marché |
|--------|----------------|--------|
| Devise | Liquidité | |

Résultat pour les Actionnaires Impact potentiel des risques susmentionnés

| Perte | Volatilité | Non-réalisation de l'objectif du Compartiment. |
|---|--|--|
| Les actionnaires sont susceptibles de perdre tout ou partie de leur argent. | La valeur des actions du Compartiment peut fluctuer. | |

Avant tout investissement, nous vous invitons à vous procurer et à consulter le prospectus en vigueur (disponible en français), le Document d'information clé pour l'investisseur (DICI) (disponible en français) et les documents de vente locaux applicables. Ces documents, de même que les rapports annuel et semestriel et les statuts peuvent être obtenus gratuitement auprès de votre conseiller financier, votre correspondant J.P. Morgan Asset Management régional, l'émetteur du fonds (voir ci-dessous) ou sur le site www.jpnam.fr.

Un résumé des droits des investisseurs est disponible en français à l'adresse <https://am.jpmorgan.com/fr/droit-des-investisseurs>. J.P. Morgan Asset Management peut décider de mettre fin aux dispositions prises aux fins de la commercialisation de ses organismes de placement collectif conformément à l'article 93a de la directive 2009/65/CE et à l'article 32a de la directive 2011/61/UE.

Le présent document ne saurait être considéré comme un conseil ou une recommandation d'investissement. Les participations et la performance ont probablement changé depuis la date de rapport. Aucun des fournisseurs des informations présentées ici, y compris celles concernant les indices et les notations, ne saurait être tenu pour responsable en cas de préjudices ou de pertes de toute nature découlant de l'utilisation de leurs informations. Aucune garantie ne peut être donnée quant à l'exactitude des informations. J.P. Morgan Asset Management décline toute responsabilité en cas d'erreur ou d'omission.

Veillez noter que si vous contactez J.P. Morgan Asset Management par téléphone, vos conversations sont susceptibles d'être enregistrées et contrôlées à des fins juridiques, de sécurité et de formation. Les informations et les données que vous communiquerez ponctuellement seront collectées, stockées et traitées par J.P. Morgan Asset Management dans le respect de la Politique de confidentialité (EMOA). La Politique de confidentialité

(EMOA) est disponible à l'adresse suivante :

www.jpnam.com/emea-privacy-policy

Pour de plus amples informations sur le marché ciblé par le compartiment, veuillez vous reporter au Prospectus.

Indicateur synthétique de risque et de rendement fondé sur la volatilité de la classe de part au cours des 5 ans écoulés. Voir le Document d'information clé pour l'investisseur (DICI) pour des informations détaillées.

Le score d'intensité carbone ESG de MSCI représente l'exposition du fonds aux entreprises et économies à forte intensité carbone, et correspond à la moyenne de l'intensité carbone/GES pondérée du portefeuille (émissions/ventes). Le Scope 1 couvre les émissions directes provenant de sources détenues ou contrôlées. Le Scope 2 couvre les émissions indirectes issues de la production d'électricité, de vapeur, de chauffage et de refroidissement achetés et consommés par l'entreprise concernée.

Informations sur les performances

Source : J.P. Morgan Asset Management. La performance de la classe d'actions est basée sur la VL (valeur liquidative) de la classe d'actions, revenu (brut) réinvesti, et inclut les charges courantes réelles, à l'exception des frais de souscription et de rachat.

Les fluctuations des taux de change peuvent avoir un impact sur la performance de votre investissement si celui-ci est effectué dans une devise autre que celle qui a été utilisée pour calculer les performances passées.

L'indice de référence est utilisé à des fins comparatives uniquement, sauf s'il y est explicitement fait référence dans l'Objectif et la Politique d'investissement du Compartiment.

Les indices ne comptabilisent pas les frais ou les charges d'exploitation et il ne vous est pas possible d'y investir directement.

Les revenus de dividendes sont présentés bruts de toutes les taxes applicables.

Le risque carbone ESG de MSCI représente l'intensité carbone moyenne pondérée du fonds et permet de mesurer l'exposition d'un fonds aux entreprises à forte intensité carbone. Ce chiffre correspond à la somme des pondérations des différents titres multipliée par l'intensité carbone des titres. Les positions courtes, les obligations souveraines, les produits dérivés, les produits titrisés et les obligations émises par des trusts sont exclus de l'analyse du risque carbone de MSCI.

Concernant les classes d'actions réactivées, la performance est indiquée à partir de la date de la réactivation et non à partir de la date de lancement.

Informations sur les participations

Les 10 principales participations excluent les instruments dérivés, les liquidités et quasi-liquidités.

Les instruments non notés comprennent les actions non notées.

La valeur en risqué (VaR) mesure la perte potentielle susceptible de survenir au cours d'une période donnée dans des conditions de marché normales et pour un niveau de confiance défini. L'approche VaR est mesurée avec un niveau de confiance de 99 %, sur un horizon d'un mois. Dans le cadre du calcul de l'exposition globale, la période de détention d'un instrument financier dérivé est d'un mois.

Sources des informations

Les informations sur le fonds, dont les calculs de la performance et les autres données, sont fournies par J.P. Morgan Asset Management (le nom commercial des sociétés de gestion d'actifs de JPMorgan Chase & Co. et ses filiales à travers le monde).

Sauf mention contraire, toutes les données sont fournies à la date du document.

© 2022 Morningstar. Tous droits réservés. Les informations ci-incluses (1) sont la propriété de Morningstar ; (2) ne peuvent être reproduites ou distribuées et (3) sont communiquées sans garantie d'exactitude, d'exhaustivité ou d'actualité. Ni Morningstar ni ses fournisseurs de contenu ne peuvent être tenus responsables d'éventuels dommages ou pertes résultant de l'utilisation de ces données.

Source de l'indice de référence : MSCI. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans ou concernée par la compilation, le calcul ou la création des données MSCI ne fournit de garantie ou d'assertion expresse ou implicite à l'égard de telles données (ou des résultats que leur utilisation est censée produire). Lesdites parties ne sauraient par ailleurs garantir que ces données sont originales, exactes, exhaustives, commercialisables ou appropriées à une fin

particulière. Sans restriction des dispositions précédentes, ni MSCI, ni ses sociétés affiliées ni un quelconque tiers impliqués dans ou concernés par la compilation, le calcul ou la création des données ne peuvent être tenus responsables en cas de dommage direct, indirect, spécial, secondaire, dommages-intérêts ou autre (y compris le manque à gagner), même si elles sont averties de la possibilité de tels dommages. Les données MSCI ne peuvent être diffusées ou autrement distribuées sans l'autorisation écrite expresse de MSCI.

Source de l'indice de référence : Les Produits ne sont pas parrainés, cautionnés, vendus ou promus par Bloomberg Barclays Capital et Bloomberg Barclays Capital ne donne aucune garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'une quelconque personne ou entité obtiendra en utilisant un quelconque indice, sa valeur d'ouverture, intrajournalière ou de clôture ou toute donnée y incluse ou y relative en lien avec un Fonds quelconque ou à une quelconque autre fin. La seule relation entre Bloomberg Barclays Capital et le Titulaire de licence en ce qui concerne les Produits est la concession sous licence de certaines marques déposées et de certains noms commerciaux de Bloomberg Barclays Capital ainsi que des indices déterminés, composés et calculés par Bloomberg Barclays Capital sans égard au Titulaire de licence ou aux Produits.

Contact régional

JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l. - Succursale de Paris, 14 place Vendôme, 75001 Paris.

Émetteur

JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l., 6, route de Trèves, L-2633 Senningerberg, Luxembourg. B27900, capital social 10.000.000 EUR.

Définitions

VL Valeur nette d'inventaire de l'actif d'un fonds moins ses engagements par action.

Bêta une mesure de la sensibilité d'un fonds aux fluctuations du marché (telles que représentées par l'indice de référence du fonds). Un bêta de 1,10 suggère que le fonds pourrait obtenir une performance supérieure de 10% à l'indice dans un marché haussier et inférieure de 10% dans un marché baissier, toutes choses étant égales par ailleurs.

Volatilité annuelle (%) une mesure absolue de la volatilité qui évalue l'ampleur de la variation de la performance à la hausse et à la baisse au cours d'une période donnée. Une forte volatilité signifie que la performance a varié considérablement au fil du temps. La mesure est exprimée sous la forme d'une valeur annualisée.

Ratio de Sharpe mesure la performance d'un investissement ajustée en fonction des risques pris (par rapport à un investissement sans risque). Plus le ratio de Sharpe est élevé, plus la performance est favorable par rapport aux risques pris.