

JPMorgan Funds -

US Sustainable Equity Fund

Anteilkasse: JPM US Sustainable Equity C2 (acc) - USD

Fondsüberblick

WKN

A3CTZR

ISIN

LU2363199626

Bloomberg

JPUSEC2 LX

Reuters

LU2363199626.LUF

Anlageziel:

Erzielung eines langfristigen Kapitalwachstums durch die vorwiegende Anlage in US-Unternehmen, die positive oder sich verbessernde ökologische und/oder soziale Eigenschaften aufweisen. Unternehmen mit positiven ökologischen und/oder sozialen Eigenschaften sind Unternehmen, die nach Auffassung des Anlageverwalters eine effektive Governance und ein herausragendes Management umweltspezifischer und/oder sozialer Themen aufweisen (nachhaltige Eigenschaften).

Anlageansatz

• Der Teilfonds wendet einen fundamentalen Bottom-up-Titelauswahlprozess an.

• Der Anlageprozess basiert auf der Nutzung des Wissens eines Teams aus auf US-Branchen spezialisierten Analysten, das bestrebt ist, langfristig attraktive und nachhaltige Anlagen zu ermitteln

• Er bezieht ESG-Faktoren ein, um Unternehmen mit starken oder sich verbessernden Nachhaltigkeitsmerkmalen zu ermitteln

Portfoliomanager

David Small  
Danielle Hines

Auflegungsdatum des Fonds

29 Jul. 2021

Domizil

Luxemburg

Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge

Ausgabeaufschlag (max.) 0,00%  
Rücknahmeabschlag (max.) 0,00%

Referenzwährung des Fonds

USD

NAV

USD 138,56

Anteilklassenwährung der Anteilkasse

USD

Auflegungsdatum

29 Jul. 2021

Fondsvolumen

USD 723,4Mio.

Laufende Kosten

0,54%

ESG-Informationen

ESG-Ansatz – Best-in-Class

Ein Anlagestil, der sich auf die nachhaltigsten Unternehmen/Emittenten innerhalb ihrer Vergleichsgruppen konzentriert.

Klassifizierung gemäß SFDR: Artikel 8

„Artikel 8“-Strategien haben positive Merkmale in Bezug auf Soziales oder die Umwelt, aber nachhaltiges Anlegen ist nicht ihr Kernziel.

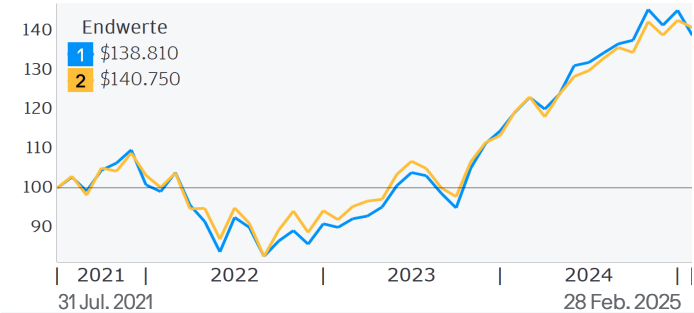
Fonds-Ratings per 28 Februar 2025

Morningstar-Gesamtbewertung™★★★★★

Morningstar-Kategorie™Aktien USA Standardwerte Blend

Wertentwicklung

- 1 Anteilkasse: JPM US Sustainable Equity C2 (acc) - USD
- 2 Referenzindex: S&P 500 Index (Total Return Net of 30% withholding tax)
- 3 Anteilkasse: Wertentw. Abzgl. Ausgabeaufschlag
- ZUWACHS VON 100.000 USD Kalenderjahre



| Fortlaufende 12-Monats-Wertentwicklung (%) |           |           |           |           |           |
|--------------------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Per Ende Februar 2025                      |           |           |           |           |           |
|                                            | 2015/2016 | 2016/2017 | 2017/2018 | 2018/2019 | 2019/2020 |
| 1                                          | -         | -         | -         | -         | -         |
| 2                                          | -         | -         | -         | -         | -         |
|                                            | 2020/2021 | 2021/2022 | 2022/2023 | 2023/2024 | 2024/2025 |
| 1                                          | -         | -         | -9,13     | 32,49     | 16,36     |
| 2                                          | -         | -         | -8,16     | 29,82     | 17,93     |
| 3                                          | -         | -         | -9,13     | -         | -         |

| ERTRAG (%) |         |          |        |                           |         |         |           |
|------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|---------|-----------|
| KUMULATIV  |         |          |        | Jährliche Wertentwicklung |         |         |           |
|            | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | YTD                       | 3 Jahre | 5 Jahre | Auflegung |
| 1          | -4,39   | -4,53    | 16,36  | -1,77                     | 11,89   | -       | 9,52      |
| 2          | -1,34   | -1,07    | 17,93  | 1,38                      | 12,03   | -       | 9,83      |

OFFENLEGUNG DER PERFORMANCE

Die Wertentwicklung der Vergangenheit ist kein Maßstab für aktuelle oder zukünftige Ergebnisse. Der Wert Ihrer Kapitalanlagen sowie der damit erzielte Ertrag können sowohl steigen als auch fallen. Die Investoren erhalten das investierte Kapital unter Umständen nicht in vollem Umfang zurück.

ESG

Weitere Informationen über unseren Ansatz für nachhaltige Investitionen bei J.P. Morgan Asset Management finden Sie unter <https://am.jpmorgan.com/de/esg>

Portfolioanalyse

| Messung              | 3 Jahre | 5 Jahre |
|----------------------|---------|---------|
| Korrelation          | 0,94    | -       |
| Alpha (%)            | -0,13   | -       |
| Beta                 | 0,92    | -       |
| Volatilität p.a. (%) | 16,33   | -       |
| Sharpe Ratio         | 0,51    | -       |
| Tracking Error (%)   | 5,53    | -       |
| Information Ratio    | -0,04   | -       |

Positionen

| Top 10           | Branche                                  | % des Vermögens |
|------------------|------------------------------------------|-----------------|
| Microsoft        | Software & Dienstleistungen              | 8,1             |
| Nvidia           | Halbl. & Hardware                        | 6,8             |
| Apple            | Halbl. & Hardware                        | 6,5             |
| Amazon.com       | Medien                                   | 6,1             |
| Mastercard       | Finanz-<br>/Unternehmensdienstleistungen | 4,3             |
| Alphabet         | Medien                                   | 3,5             |
| Abbvie           | Pharma                                   | 2,4             |
| UnitedHealth     | Gesundheitsdienstleistungen              | 2,1             |
| Procter & Gamble | Nicht-zykl. Konsumwerte                  | 1,9             |
| Howmet Aerospace | Zyklische Industrietitel                 | 1,8             |

| SEKTOREN (%)                             | Im Vergleich zur Benchmark |      |
|------------------------------------------|----------------------------|------|
| Halbl. & Hardware                        | 20,3                       | +0,5 |
| Medien                                   | 11,3                       | -1,1 |
| Pharma                                   | 11,2                       | +2,5 |
| Software & Dienstleistungen              | 10,9                       | +0,8 |
| Zyklische Industrietitel                 | 8,9                        | -0,7 |
| Finanz-<br>/Unternehmensdienstleistungen | 7,1                        | +1,0 |
| Großbanken und Broker                    | 6,7                        | +1,3 |
| Einzelhandel                             | 5,2                        | -0,2 |
| Versicherungen                           | 3,3                        | +0,9 |
| REITs                                    | 2,4                        | +0,3 |
| Sonstige                                 | 11,5                       | -6,5 |
| Barvermögen                              | 1,2                        | +1,2 |

Aufgrund von Rundungen ist es möglich, dass die Addition der Zahlen nicht 100 ergibt.

Hauptrisiken

Der Teilfonds unterliegt **Anlagerisiken** und **sonstigen verbundenen Risiken** aus den Techniken und Wertpapieren, die er zur Erreichung seines Anlageziels einsetzt. In der Tabelle rechts wird erläutert, wie diese Risiken miteinander im Zusammenhang stehen. Sie erklärt auch die **Ergebnisse für den Anteilseigner**, die sich auf eine Anlage in diesem Teilfonds auswirken könnten. Anleger sollten im Verkaufsprospekt auch die [Beschreibung der Risiken](#) mit einer vollständigen Beschreibung jedes einzelnen Risikos lesen.

**Anlagerisiken** Risiken in Verbindung mit den Techniken und Strategien des Teilfonds

| Techniken   | Wertpapiere |
|-------------|-------------|
| Absicherung | Aktien      |

**Sonstige verbundene Risiken** Weitere Risiken, denen der Teilfonds durch den Einsatz der oben aufgeführten Techniken und Wertpapiere ausgesetzt ist

Markt

**Ergebnisse für den Anteilinhaber** *Potenzielle Auswirkungen der oben genannten Risiken*

| Verlust                                                                          | Volatilität                                        | Verfehlen des Ziels des Teilfonds. |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------------------|
| Anteilinhaber könnten ihren Anlagebetrag zum Teil oder in voller Höhe verlieren. | Der Wert der Anteile des Teilfonds wird schwanken. |                                    |

Allgemeine Offenlegungen

Lesen Sie vor einer Anlage den aktuellen Verkaufsprospekt (verfügbar auf Deutsch), Basisinformationsblatt (KID) (verfügbar auf Deutsch) und sämtliche relevanten lokalen Angebotsunterlagen. Diese Dokumente sowie die aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte

die Informationen über die nachhaltigkeitsrelevanten Aspekte und die Satzung sind kostenlos bei Ihrem Finanzberater, Ihrem regionalen Ansprechpartner bei J.P. Morgan Asset Management, dem Fondsemittenten (siehe unten) oder auf [www.jpmmam.de](http://www.jpmmam.de) erhältlich.

Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte ist auf Deutsch abrufbar unter <https://am.jpmorgan.com/de/anlegerrechte>. J.P. Morgan Asset Management kann beschließen, den Vertrieb der kollektiven Investments zu widerrufen.

Dieses Material ist nicht als Beratung oder Anlageempfehlung aufzufassen. Die Wertpapierbestände und Wertentwicklung des Fonds haben sich wahrscheinlich seit dem Berichtsstichtag verändert.

Im nach geltendem Recht zulässigen Umfang können wir Telefongespräche aufzeichnen und die elektronische Kommunikation überwachen, um unsere rechtlichen und regulatorischen Pflichten sowie unsere internen Richtlinien einzuhalten. Die personenbezogenen Daten werden von J.P. Morgan Asset Management gemäß unserer EMEA-Datenschutzrichtlinie ([www.jpmmorgan.com/emea-privacy-policy](http://www.jpmmorgan.com/emea-privacy-policy)) erfasst, gespeichert und verarbeitet.

Weitere Informationen zum Zielmarkt des Teilfonds finden Sie im Verkaufsprospekt.

Risikoindikator - Der Risikoindikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt 5 Jahr(e) halten. Das Risiko des Produkts kann erheblich höher sein, wenn es für einen kürzeren Zeitraum als die empfohlene Haltedauer gehalten wird.

Die laufenden Kosten sind die Kosten, die im EU-Basisinformationsblatt für PRIIPs verwendet werden. Diese Kosten entsprechen den Gesamtkosten für die Verwaltung und den Betrieb des Fonds, einschließlich der Verwaltungsgebühren,

Verwaltungskosten und sonstiger Aufwendungen (ohne Transaktionskosten). Die Aufschlüsselung der Kosten entspricht den im Fondsprospekt angegebenen Höchstbeträgen. Ausführlichere Informationen entnehmen Sie bitte dem Fondsprospekt und dem PRIIPs-Basisinformationsblatt, die auf unserer Website verfügbar sind.

Informationen zur Wertentwicklung

Quelle: J.P. Morgan Asset Management. Die Fondsp performance wird anhand des Nettoinventarwerts (NAV) der Anteilkasse bei Wiederanlage der Erträge (brutto) inklusive tatsächlicher laufender Gebühren und exklusive etwaiger Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge angegeben.

Die Rendite Ihrer Anlage kann sich aufgrund von Währungsschwankungen ändern, wenn Ihre Anlage in einer anderen Währung als derjenigen erfolgt, die bei der Berechnung der historischen Wertentwicklung verwendet wurde.

Die Indizes berücksichtigen weder Gebühren noch operative Kosten. Eine Anlage in die Indizes ist nicht möglich.

Sofern im Anlageziel und der Anlagepolitik des Teilfonds nicht ausdrücklich anders angegeben, dient der Vergleichsindex nur zu Vergleichszwecken.

INFORMATIONEN ZUR DARSTELLUNG DER WERTENWICKLUNG

Die Wertentwicklung wird nach BVI-Methode dargestellt. Die BVI-Methode berücksichtigt alle auf Fondsebene anfallenden Kosten (Verwaltungs- und Beratungsgebühr sowie Betriebs- und Verwaltungsaufwendungen). Zusätzliche Kosten, die sich auf die Wertentwicklung auswirken, z.B. Depotgebühren, Rücknahmegebühr, Umtauschgebühren sowie etwaige Steuern, können variieren und daher in der Darstellung nicht berücksichtigt werden.

Informationsquellen

Fondsinformationen, einschließlich Performanceberechnungen und sonstige Daten, werden von J.P. Morgan Asset Management (Marketingname des Geschäftsbereichs Asset Management von JPMorgan Chase & Co. und ihrer weltweiten Tochtergesellschaften) bereitgestellt.

Der Stand der Daten entspricht, soweit nicht anders angegeben, dem Datum des Dokuments.

© 2025 Morningstar. Alle Rechte vorbehalten. Die hierin enthaltenen Informationen: (1) sind Eigentum von Morningstar; (2) dürfen nicht kopiert oder verbreitet werden; und (3) für ihre Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität wird keine Gewähr übernommen. Weder Morningstar noch seine Inhaltsanbieter sind für Schäden oder Verluste verantwortlich, die aus einer Nutzung dieser Informationen entstehen.

Benchmark-Quelle: Der S&P 500 Index (Total Return Net of 30% withholding tax) („Index“) ist ein Produkt von S&P Dow Jones Indices LLC und/oder verbundenen Unternehmen von S&P Dow Jones Indices LLC und wurde für die Nutzung durch JP Morgan Chase Bank N.A. lizenziert. Copyright © 2023. S&P Dow Jones Indices LLC, eine Tochter von S&P Global, Inc., und/oder verbundene Unternehmen von S&P Dow Jones Indices LLC. Alle Rechte vorbehalten.

Regionaler Ansprechpartner

JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l., Frankfurt Branch, Tanustor 1, D-60310 Frankfurt.

Herausgeber

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

Definitionen

**NAV** Nettoinventarwert der Vermögenswerte des Fonds, abzüglich der Verbindlichkeiten je Anteil.

**Morningstar-Gesamtbewertung™** Bewertung der Fondsp performance in der Vergangenheit auf Basis von Rendite und Risiko; ermöglicht einen Vergleich ähnlicher Anlagen mit den Produkten der Konkurrenz. Anlageentscheidungen sollten nicht aufgrund eines hohen Ratings allein erfolgen.

**Korrelation** Misst die Stärke und Richtung des Verhältnisses zwischen den Renditen von Fonds und Vergleichsindizes. Eine Korrelation von 1,00 bedeutet, dass sich der Fonds und der Vergleichsindex im Gleichschritt in dieselbe Richtung bewegen.

**Alpha (%)** Ein Maß für die Überrendite, die ein Manager gegenüber dem Vergleichsindex erzielt. Ein Alpha von 1,00 bedeutet, dass ein Fonds seinen Vergleichsindex um 1% übertroffen hat.

**Beta** Drückt die Sensitivität eines Fonds gegenüber Marktbewegungen (repräsentiert durch den Vergleichsindex des Fonds) aus. Ein Beta von 1,10 bedeutet, dass sich der Fonds in steigenden Märkten um 10% besser und in fallenden Märkten um 10% schlechter als der Vergleichsindex entwickeln könnte, sofern alle anderen Faktoren gleich bleiben. Anlagen mit höherem Beta sind in der Regel riskanter.

**Volatilität p.a. (%)** Gibt an, wie stark die Renditen innerhalb eines bestimmten Zeitraums nach oben und unten schwanken.

**Sharpe Ratio** Wertentwicklung einer Anlage im Verhältnis zum

eingegangenen Risiko (gegenüber einer risikofreien Anlage). Je höher die Sharpe Ratio ist, desto besser fallen die Erträge im Verhältnis zum eingegangenen Risiko aus.

**Tracking Error (%)** Erfasst die Abweichung der Fondsrendite von der Rendite des Vergleichsindex. Je niedriger der Wert ist, desto genauer entsprach die historische Wertentwicklung des Fonds der seines Vergleichsindex.

**Information Ratio** Misst, ob ein Manager besser oder schlechter als der Vergleichsindex abschneidet und berücksichtigt dabei das zur Erzielung der Rendite eingegangene Risiko. Ein Manager, der um 2% p. a. besser als der Vergleichsindex abschneidet, hat eine höhere Information Ratio als ein Manager, der die gleiche Überrendite erzielt hat, dafür aber ein höheres Risiko eingegangen ist.