



J. Safra Sarasin

## JSS Commodity - Transition Enhanced Y USD dist

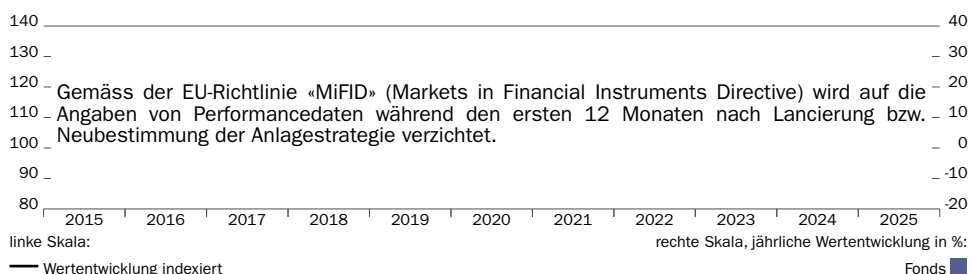
Daten per 28. Februar 2025 | Quelle: JSS Investmentfonds AG | Seite 1 von 3

### Fondsportrait

Der JSS Commodity - Transition Enhanced strebt Kapitalwachstum in Verbindung mit den Rohstoffmärkten an. Der Fonds investiert hierzu mittels Derivative (einschließlich Total Return Swaps) in diversifizierte Terminkontrakte auf physische Rohstoffe. Die Auswahl der Rohstoffanlagen erfolgt mit dem Ziel, eine optimale Risikostreuung zu erreichen, wobei jedoch auch versucht wird, durch ein aktives Management der Derivate eine Überrendite zu erzielen. Es wird erwartet, dass der Teilfonds den Großteil (mindestens 60%) seines Nettovermögens in Investment-Grade-Anleihen mit einer Laufzeit von weniger als zwei Jahren investiert. Im Rahmen des Anlageprozesses für festverzinsliche Wertpapiere werden finanziell relevante ESG-Aspekte im gesamten Anlageprozess systematisch integriert, um kontroverse Positionen zu vermeiden, ESG-Risiken zu vermindern und Opportunitäten zu nutzen.

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und bildet keine Benchmark nach. Der Teilfonds wird jedoch unter Bezugnahme auf den Bloomberg Commodity Index TR (die „Benchmark“) verwaltet.

### Wertentwicklung Netto (in USD) per 28.02.2025



|       | 1 Monat | 3 Monate | YTD  | 1 Jahr | 3 Jahre p.a. | 5 Jahre p.a. | 10 Jahre p.a. |
|-------|---------|----------|------|--------|--------------|--------------|---------------|
| Fonds | n.a.    | n.a.     | n.a. | n.a.   | n.a.         | n.a.         | n.a.          |
| BM    | n.a.    | n.a.     | n.a. | n.a.   | n.a.         | n.a.         | n.a.          |

|       | 2024 | 2023 | 2022 | 2021 | 2020 | Seit Lancierung |
|-------|------|------|------|------|------|-----------------|
| Fonds | n.a. | n.a. | n.a. | n.a. | n.a. | n.a.            |
| BM    | n.a. | n.a. | n.a. | n.a. | n.a. | n.a.            |

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.

### Aufteilung nach Sektoren (Zielgewichtung)

|        |                           |
|--------|---------------------------|
| 30.03% | Transition                |
| 6.01%  | EU-Emissionshandelssystem |
| 6.01%  | Kupfer                    |
| 6.01%  | Nickel                    |
| 6.01%  | Zink                      |
| 6.01%  | Zinn                      |
| 28.03% | Energie                   |
| 7.01%  | Erdgas                    |
| 7.01%  | Erdöl                     |
| 7.01%  | Gasöl                     |
| 7.01%  | Rohöl (Brent)             |

|        |                  |
|--------|------------------|
| 14.01% | Metalle          |
| 7.01%  | Gold             |
| 7.01%  | Silber           |
| 27.93% | Agrarprodukte    |
| 3.10%  | Baumwolle        |
| 3.10%  | Kaffee (Robusta) |
| 3.10%  | Kakao            |
| 3.10%  | Lebende Rinder   |
| 3.10%  | Mais             |
| 3.10%  | Sojabohnen       |
| 3.10%  | Sojabohnenmehl   |
| 3.10%  | Sojabohnenöl     |
| 3.10%  | Zucker           |

### Fondsübersicht

|                                                               |                                                     |
|---------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|
| Inventarwert pro Anteil                                       | 104.18                                              |
| Fondsvermögen in Mio.                                         | 95.69                                               |
| Fondsleitung                                                  | J. Safra Sarasin<br>Investmentfonds AG, Basel       |
| Depotbank                                                     | CACEIS Investor Service<br>Bank S.A., Luxembourg    |
| Portfolio Management                                          | AM Quantitative, Bank J.<br>Safra Sarasin AG, Basel |
| Portfolio Manager                                             | George Cotton<br>Benoît Harger                      |
| Fondsdomizil                                                  | Luxemburg                                           |
| ISIN-Nr.                                                      | LU2833322766                                        |
| Wertpapierkenn-Nr.                                            | A40TY4                                              |
| Bloomberg                                                     | JSTEYDD LX                                          |
| Lancierungsdatum                                              | 29. Oktober 2024                                    |
| Anteilsklasse                                                 |                                                     |
| Lancierungsdatum                                              | 29. Oktober 2024                                    |
| Teilfonds                                                     |                                                     |
| Abschluss Rechnungsjahr                                       | Juni                                                |
| Laufende Kosten*                                              | 0.55%                                               |
| Verwaltungsgebühr                                             | 0.20%                                               |
| Referenzwährung                                               | USD                                                 |
| Ausschüttung                                                  | USD 0.00                                            |
| Letzte Ausschüttung                                           | -                                                   |
| Verkaufsgebühr                                                | 0.0%                                                |
| Rücknahmegebühr                                               | 0.0%                                                |
| Ausgabeaufschlag/<br>Rücknahmeabschlag<br>zugunsten des Fonds | 0.0%                                                |
| Rechtsform                                                    | SICAV                                               |
| Benchmark (BM)                                                | Bloomberg Commodity Index Total<br>Return           |

\*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.

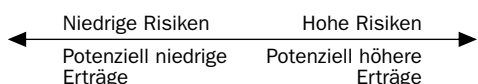
### Settlement Details

|                                    |             |
|------------------------------------|-------------|
| Zeichnungen/Rücknahmen             | täglich     |
| Kündigungsfrist                    | n.a.        |
| Abwicklung subs / reds             | T+2 / T+2   |
| Orderannahmeschluss (MEZ)          | n.a.        |
| Mindestestanlagebetrag             | n.a.        |
| Verwässerungsausgl. Zuschlag/Abzug | n.a. / n.a. |

| Statistische Kennzahlen | Fonds | Benchmark |
|-------------------------|-------|-----------|
| Volatilität             | n.a.  | n.a.      |
| Beta                    | n.a.  | n.a.      |
| Sharpe Ratio            | n.a.  | n.a.      |
| Information Ratio       | n.a.  | n.a.      |
| Tracking Error          | n.a.  | n.a.      |

Die statistischen Kennzahlen werden erst ab einem Beobachtungszeitraum von 36 Monaten berechnet.

### Risiko- und Ertragsprofil



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.

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



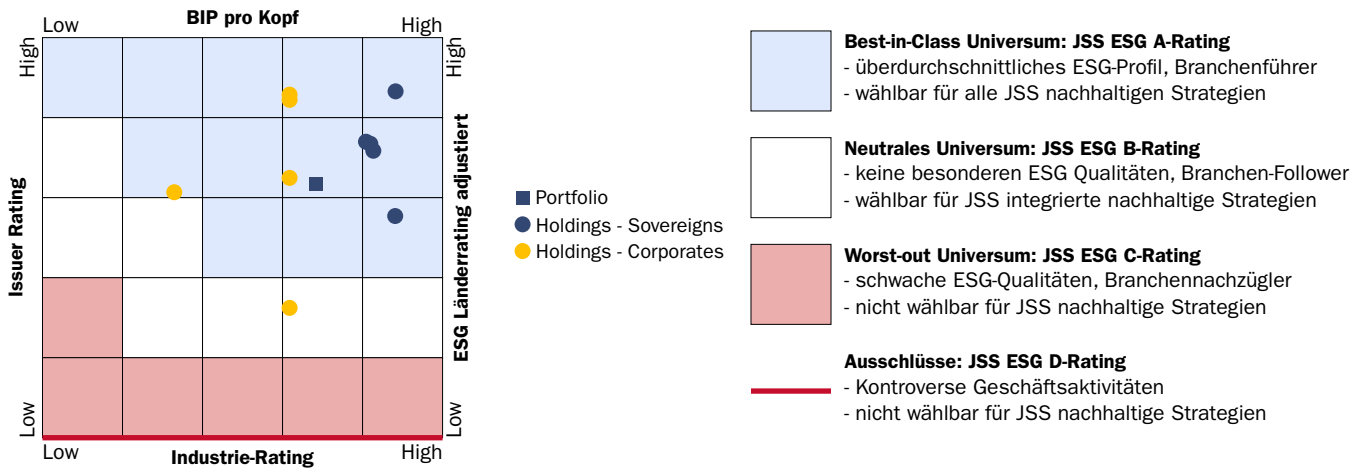
# J. Safra Sarasin

## JSS Commodity - Transition Enhanced Y USD dist

Daten per 28. Februar 2025 | Quelle: JSS Investmentfonds AG | Seite 2 von 3

### Fixed Income Collateral Portfolio

### J. Safra Sarasin Nachhaltigkeitsmatrix



### Obligationen-Portfolio Kennzahlen

|                            |        |
|----------------------------|--------|
| Ø-Rating                   | AAA    |
| Ø-Restlaufzeit (in Jahren) | 1.14   |
| Verfallrendite             | 4.40 % |
| Modified Duration          | 0.95   |

**Sustainability Matrix:** Mittels unserer eigens entwickelten Methodologie werden Unternehmen und Branchen anhand von Nachhaltigkeitskriterien bewertet (auf einer Skala von 0-5). Daraus ergibt sich für jedes einzelne Unternehmen eine bestimmte Position innerhalb unserer Sustainability Matrix, in der sowohl das Exposure einer bestimmten Branche gegenüber Nachhaltigkeitsrisiken (Branchenrating) als auch die Fähigkeit eines Unternehmens, diese Risiken zu mindern (Unternehmensrating), zum Ausdruck kommen.



J. Safra Sarasin

## JSS Commodity - Transition Enhanced Y USD dist

Daten per 28. Februar 2025 | Quelle: JSS Investmentfonds AG | Seite 3 von 3

### Rechtliche Hinweise - Ausgabe Deutschland:

Informationen für Anleger in Deutschland: Bei dieser Publikation handelt es sich um Marketingmaterial für eine Anlage, das ausschliesslich zu Informationszwecken und zur alleinigen Verwendung durch den Empfänger in Deutschland erstellt wurde. Die Satzung sowie die Jahres- und Halbjahresberichte, der Prospekt (jeweils in deutscher oder englischer Sprache) und/oder das Basisinformationsblatt (Key Information Document, KID) stehen im Allgemeinen (auf Deutsch, Französisch, Italienisch, Englisch, Dänisch, Niederländisch, Schwedisch und Spanisch) kostenfrei bei J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A., 17-21, Boulevard Joseph II, L-1840 Grossherzogtum Luxemburg oder unter <https://jsafrasarasin.com/content/jsafrasarasin/language-masters/en/company/locations/country-pages/Fund-Management-Luxembourg-SA.html> zur Verfügung.

Die Aussagen in diesem Dokument 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. Anlegerbeschwerden können direkt bei der Verwaltungsgesellschaft J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A., 17-21, Boulevard Joseph II, L-1840 Grossherzogtum Luxemburg eingereicht werden. Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte (auf Deutsch, Französisch, Italienisch, Englisch, Dänisch, Niederländisch, Schwedisch und Spanisch) findet sich unter

<https://jsafrasarasin.com/content/jsafrasarasin/language-masters/en/company/locations/country-pages/Fund-Management-Luxembourg-SA/information-for-investors>. Der JSS Investmentfonds SICAV (der „Fonds“) ist ein OGAW in Form einer offenen Investmentgesellschaft (société d'investissement à capital variable, „SICAV“) nach luxemburgischen Recht und wird von der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) beaufsichtigt. Aktien der Teilfonds des JSS Investmentfonds sind in der Bundesrepublik Deutschland, der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht angezeigt und zum Vertrieb zugelassen. Die in diesem Dokument beschriebene Anlage ist ein Subfonds (der „Subfonds“) des JSS Investmentfonds SICAV. 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 Subfonds verbundenen Risiken informieren. Ausführliche Informationen in Bezug auf die Risiken und Vorteile finden sich im Prospekt oder KID der jeweiligen Anteilsklassen des Subfonds. 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 und Subfonds 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 Wechselkurschwankungen 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 Subfonds 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 Subfonds registriert ist, kann von J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. bezogen werden, die beschliessen kann, die für den Vertrieb des Fonds oder Subfonds 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 Subfonds halten. Ausserdem ist es untersagt, diesen Personen Anteile des Subfonds öffentlich anzubieten, auszugeben oder zu verkaufen. © J. Safra Sarasin