



J. Safra Sarasin

JSS Investmentfonds SICAV

Ein luxemburgischer Umbrella-Fonds
R.C.S. Nummer B 40.633

**Jahresbericht einschließlich geprüfem Abschluss
30. Juni 2023**

Auf der Grundlage des vorliegenden Jahresberichts einschließlich geprüftem Abschluss können keine Zeichnungen entgegengenommen werden. Zeichnungen können nur auf Basis des aktuellen ausführlichen Prospektes, der wesentlichen Anlegerinformationen (KIIDs) sowie des letzten Jahresberichts, einschließlich des geprüften Abschlusses, und gegebenenfalls des danach veröffentlichten Halbjahresberichts erfolgen.

Der ausführliche Prospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen (KIIDs) und die aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos bei den in diesem Bericht aufgeführten Zahl- und Vertriebsstellen bezogen werden.

Im Folgenden werden die Namen der Teilfonds der JSS Investmentfonds SICAV (z. B. „JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets“) ohne Angabe der Umbrella-Bezeichnung „JSS Investmentfonds SICAV“ verwendet. Eine Übersicht über die vollständige Bezeichnung der einzelnen Teilfonds ist in Erläuterung 1 im Kapitel „Erläuterungen“ aufgeführt.

Inhaltsverzeichnis

Informationen	5
Organisation und Verwaltung	16
Nettoinventarwertaufstellung	18
Fondsperformance	41
Bericht der Anlageverwalter	46
Bericht des <i>Réviseur d'Entreprises Agréé</i>	51
Nettovermögensaufstellung	54
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens	63
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	72
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	82
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	87
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	89
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	92
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	96
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	99
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	101
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	103
JSS Sustainable Bond CHF	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	109
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	112
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	119
JSS Sustainable Equity - Europe	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	125
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	127
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	129
JSS Sustainable Equity - USA	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	131

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	133
JSS Sustainable Equity - Green Planet	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	145
JSS Bond - USD High Yield	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	147
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	158
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	162
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	164
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	166
JSS Equity - All China	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	168
Erläuterungen	171
Sonstige ungeprüfte Informationen	188

Informationen*

per 30.06.2023

	Bezeichnung der Anteilsklasse	ISIN	Benchmark
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C CHF acc hedged-	LU1073944271	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C EUR acc hedged-	LU1073944354	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C USD acc-	LU1073944198	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C USD dist-	LU1210450364	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-I CHF acc hedged-	LU1073944511	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-I USD acc-	LU1073944438	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-I USD dist-	LU1210450448	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P CHF acc hedged-	LU1073943893	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P EUR acc hedged-	LU1073943976	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P EUR dist hedged-	LU1244594351	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P USD acc-	LU1073943620	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P USD dist-	LU1210450281	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y CHF acc hedged-	LU1201473821	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y CHF dist hedged-	LU1244594948	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y EUR acc hedged-	LU1201474043	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y EUR dist hedged-	LU1244595085	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y GBP dist hedged-	LU1545798859	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y USD acc-	LU1201474126	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y USD dist-	LU1210450521	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-C USD acc-	LU0950588334	MSCI Emerging Markets NR Index USD
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-C USD dist-	LU1732170136	MSCI Emerging Markets NR Index USD
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-I USD acc-	LU1111702400	MSCI Emerging Markets NR Index USD
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-M USD acc-	LU1860229043	MSCI Emerging Markets NR Index USD
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-P USD dist-	LU0068337053	MSCI Emerging Markets NR Index USD
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C EUR acc-	LU0950588763	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C EUR dist-	LU1732170649	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C GBP acc-	LU1354468743	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C H1 GBP dist-	LU2592797984	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C USD acc-	LU1111702822	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C USD dist-	LU2076226567	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-E USD acc-	LU2076227615	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-E USD dist-	LU2076227532	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-I USD acc-	LU1111703044	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-I10 EUR acc-	LU2569393635	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-M USD acc-	LU2076228340	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P EUR acc-	LU0533812276	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P EUR dist-	LU0375216479	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P USD acc-	LU1096892549	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P USD dist-	LU1732170565	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-S EUR acc-	LU1842717297	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-S EUR dist-	LU1842717370	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-Y EUR dist-	LU2076227706	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-Y USD acc-	LU2076228001	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-Y USD dist-	LU2076227961	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)	-C CHF acc-	LU0950588920	30% MSCI World NR Index CHF, 20% MSCI World NR Index CHF Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index CHF Hedged.
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)	-C CHF dist-	LU1732170995	30% MSCI World NR Index CHF, 20% MSCI World NR Index CHF Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index CHF Hedged.
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)	-P CHF dist-	LU0058890657	30% MSCI World NR Index CHF, 20% MSCI World NR Index CHF Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index CHF Hedged.
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-C EUR acc-	LU0950589068	30% MSCI World NR Index EUR, 20% MSCI World NR Index EUR Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index.
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-C EUR dist-	LU1732171027	30% MSCI World NR Index EUR, 20% MSCI World NR Index EUR Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index.
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-P EUR dist-	LU0058893917	30% MSCI World NR Index EUR, 20% MSCI World NR Index EUR Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index.

* Siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

per 30.06.2023

	Bezeichnung der Anteilsklasse	ISIN	Benchmark
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-S EUR acc-	LU1842716646	30% MSCI World NR Index EUR, 20% MSCI World NR Index EUR Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index.
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)	-P EUR acc-	LU0198388380	45% MSCI World NR Index EUR, 30% MSCI World NR Index EUR Hedged, 25% ICE BofA Euro Broad Market Index.
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C CHF acc hedged-	LU1111708860	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C EUR acc-	LU1111708787	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C GBP acc hedged-	LU1111709082	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C USD acc hedged-	LU1111708944	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I CHF acc hedged-	LU1111709322	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I EUR acc-	LU1111709249	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I USD acc hedged-	LU1111709595	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I USD dist hedged-	LU1244595754	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I10 CHF acc hedged-	LU2075973177	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I10 EUR acc-	LU2075973334	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I3 CHF acc hedged-	LU2075972286	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 CHF acc hedged-	LU1629314078	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 EUR acc-	LU1629313856	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 EUR dist-	LU1629313930	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 GBP dist hedged-	LU1629314581	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 USD acc hedged-	LU1629314235	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 USD dist hedged-	LU1629314318	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ3 CHF acc hedged-	LU2075975206	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ3 EUR acc-	LU2075975461	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ3 EUR dist-	LU2075975545	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ10 USD acc hedged-	LU2075977087	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ10 CHF acc hedged-	LU2075976600	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ10 GBP acc hedged-	LU2075977327	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P CHF acc hedged-	LU1111708431	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P EUR acc-	LU1111708357	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P EUR dist-	LU1210451099	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P USD acc hedged-	LU1111708514	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P USD dist hedged-	LU1244595242	Keine
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C CHF acc-	LU2076229074	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C EUR acc-	LU0950589498	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C EUR dist-	LU1732171373	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C GBP acc-	LU2076229405	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C USD acc-	LU1111703127	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I EUR acc-	LU0405184523	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I USD (BRL hedged) acc-	LU2067136072	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I USD acc-	LU1111703390	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I USD dist-	LU1991390706	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I10 CHF acc-	LU2008796604	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I10 EUR acc-	LU2008796273	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I10 USD acc-	LU2008796430	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I30 CHF acc-	LU2427699371	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-IH1 NOK acc-	LU2076230247	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-M CHF acc-	LU2499280977	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-M EUR acc-	LU0950589571	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P EUR acc-	LU0480508919	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P EUR dist-	LU0229773345	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P SGD acc-	LU2361429579	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P USD acc-	LU1111703473	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P USD dist-	LU1732171290	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-S EUR dist-	LU2076230833	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-Y EUR acc-	LU1205684001	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-Y USD dist-	LU2161043588	MSCI World NR Index

* Siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

per 30.06.2023

	Bezeichnung der Anteilsklasse	ISIN	Benchmark
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C CHF acc hedged-	LU1073945245	ICE BofA Swiss Franc 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C EUR acc hedged-	LU1073945328	ICE BofA Euro Currency 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C EUR dist hedged-	LU1244596133	ICE BofA Euro Currency 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C USD acc-	LU1073945161	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C USD dist-	LU1210452063	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-I USD acc-	LU1073945591	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P CHF acc hedged-	LU1073944941	ICE BofA Swiss Franc 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P EUR acc hedged-	LU1073945088	ICE BofA Euro Currency 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P USD acc-	LU1073944867	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P USD dist-	LU1210451842	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-Y CHF acc hedged-	LU1201473581	ICE BofA Swiss Franc 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-Y EUR acc hedged-	LU1201473664	ICE BofA Euro Currency 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-Y USD dist-	LU1210452659	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond CHF	-C CHF acc-	LU0950591809	SBI Foreign AAA-BBB TR Index
JSS Sustainable Bond CHF	-M CHF acc-	LU0950591981	SBI Foreign AAA-BBB TR Index
JSS Sustainable Bond CHF	-P CHF dist-	LU0121751324	SBI Foreign AAA-BBB TR Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-C CHF acc hedged-	LU2076224786	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-C EUR acc-	LU0950592104	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-C EUR dist-	LU1732171969	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-I EUR acc-	LU2076225163	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-I EUR dist-	LU2076225247	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-P CHF dist hedged-	LU2076224273	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-P EUR acc-	LU2076223622	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-P EUR dist-	LU0158938935	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-Y CHF acc hedged-	LU2076226054	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-Y EUR acc-	LU1752454568	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-Y EUR dist-	LU1752454485	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-C EUR acc-	LU0950591718	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-C EUR dist-	LU1732172009	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-I EUR acc-	LU0734492860	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-M EUR acc-	LU0776582891	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-P EUR dist-	LU0045164786	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-Y CHF dist hedged-	LU2312587103	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-Y EUR acc-	LU1205683706	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Equity - Europe	-C EUR acc-	LU0950592369	MSCI Europe NR Index
JSS Sustainable Equity - Europe	-P EUR acc-	LU0484532444	MSCI Europe NR Index
JSS Sustainable Equity - Europe	-P EUR dist-	LU0058891119	MSCI Europe NR Index
JSS Sustainable Equity - Europe	-P USD acc-	LU1096900078	MSCI Europe NR Index
JSS Sustainable Equity - Europe	-Y EUR acc-	LU1205683888	MSCI Europe NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-C CHF acc-	LU2273127774	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-C EUR acc-	LU0950592443	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-C USD acc-	LU1111704364	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-I CHF acc-	LU2273128319	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-I EUR acc-	LU1111704521	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-M CHF acc-	LU2499280894	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-M EUR acc-	LU0749004452	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-P EUR dist-	LU0097427784	MSCI World NR Index

* Siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

per 30.06.2023

	Bezeichnung der Anteilsklasse	ISIN	Benchmark
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-P USD acc-	LU1111704448	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-C EUR acc-	LU0950592872	S&P Developed Property Index in EUR
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-C EUR dist-	LU1991392827	S&P Developed Property Index in EUR
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-I EUR acc-	LU0950592955	S&P Developed Property Index in EUR
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-P EUR acc-	LU0288928376	S&P Developed Property Index in EUR
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-P EUR dist-	LU1991392074	S&P Developed Property Index in EUR
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-P USD acc-	LU1111705098	S&P Developed Property Index in USD
JSS Sustainable Equity - USA	-C USD acc-	LU0950593094	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Equity - USA	-I USD acc-	LU1111705254	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Equity - USA	-I USD dist-	LU2076232961	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Equity - USA	-I10 USD acc-	LU2427700138	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Equity - USA	-P USD acc-	LU0526864581	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Equity - USA	-P USD dist-	LU2076232706	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Equity - USA	-Y USD acc-	LU1629314664	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-C EUR acc-	LU0950593177	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I EUR acc-	LU1842720168	None
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I EUR dist-	LU1842720242	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I H2 CHF dist-	LU2273130562	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I USD H2 acc-	LU1842720325	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P CHF H2 acc-	LU1111702079	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P EUR acc-	LU1111705338	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P EUR dist-	LU0058892943	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P USD H2 acc-	LU1842719665	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C CHF H1 acc-	LU1111702236	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C EUR acc-	LU0950593250	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C EUR dist-	LU1732172694	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C USD acc-	LU1111705684	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C USD dist-	LU1732172777	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I CHF acc-	LU1965939850	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I EUR acc-	LU0333595519	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I EUR dist-	LU1732172850	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I10 EUR acc-	LU2427703074	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P CHF H1 acc -	LU1111702319	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P EUR acc-	LU0707700596	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P EUR dist-	LU0333595436	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P GBP dist-	LU1545800341	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P USD H1 acc-	LU1120832198	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P USD dist-	LU0950593417	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-S EUR dist-	LU1842716729	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-Y EUR acc-	LU1205684183	Keine
JSS Bond - USD High Yield	-C EUR acc hedged-	LU1184841341	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-C USD acc-	LU1184840962	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-C USD dist-	LU1210450109	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-I CHF acc hedged-	LU1184841937	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-I USD acc-	LU1184841770	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-I USD dist-	LU1210450018	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-P CHF acc hedged-	LU1184840293	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-P CHF dist hedged-	LU1184840459	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-P EUR acc hedged-	LU1184840533	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index

* Siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

per 30.06.2023

	Bezeichnung der Anteilsklasse	ISIN	Benchmark
JSS Bond - USD High Yield	-P EUR dist hedged-	LU1184840707	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-P USD acc-	LU1184840020	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-P USD dist-	LU1210449945	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C CHF acc hedged-	LU1332517405	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C EUR acc hedged-	LU1332517660	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C USD acc-	LU1332517231	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C USD dist-	LU1332517314	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I CHF acc hedged-	LU1332518122	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I EUR acc hedged-	LU1332518478	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I EUR dist hedged-	LU1332518551	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I USD acc-	LU1332517827	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I USD dist-	LU1332518049	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-M CHF acc hedged-	LU1332518635	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P CHF acc hedged-	LU1332516852	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P EUR acc hedged-	LU1332517074	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P EUR dist hedged-	LU1332517157	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P USD acc-	LU1332516696	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P USD dist-	LU1332516779	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y CHF acc hedged-	LU1405747244	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y EUR acc hedged-	LU1405747327	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y GBP dist hedged-	LU1405749539	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y USD acc-	LU1405747087	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y USD dist-	LU1405747160	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-C EUR acc-	LU1752455532	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-C EUR dist-	LU1752455615	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-C USD acc-	LU1752455375	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-E EUR acc-	LU2161045799	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-E EUR dist-	LU2161045872	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-I USD acc-	LU1752455888	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P EUR acc-	LU1752454998	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P EUR dist-	LU1752455292	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P USD acc-	LU1752454642	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P USD dist-	LU1752454725	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-Y USD acc-	LU1752456001	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-Y USD dist-	LU1752456266	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C CHF acc-	LU1842718345	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C EUR acc-	LU1752457405	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C USD acc-	LU1752456936	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C USD dist-	LU1752457157	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-E USD acc-	LU1842717453	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-E USD dist-	LU1842717537	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I CHF acc-	LU1842718691	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I EUR acc-	LU2076231567	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I USD (BRL hedged) acc-	LU1842717883	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I USD acc-	LU1752458551	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I10 USD acc-	LU2273126701	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-M USD acc-	LU1842718006	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P CHF dist-	LU1842718261	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P EUR acc-	LU1752456696	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P EUR dist-	LU1752456852	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P USD acc-	LU1752456340	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P USD dist-	LU1752456423	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-Y USD acc-	LU1752458049	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-Y USD dist-	LU1752458478	Keine

* Siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

per 30.06.2023

	Bezeichnung der Anteilsklasse	ISIN	Benchmark
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-C USD acc-	LU1835934479	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-C USD dist-	LU1835934552	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-I USD acc-	LU1835934636	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-I USD dist-	LU1835934719	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-M USD acc-	LU1835935013	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-P USD acc-	LU1835934123	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-P USD dist-	LU1835934396	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-Y USD acc-	LU1835934800	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-Y USD dist-	LU1835934982	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Equity - All China	-C CHF acc-	LU1965940783	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-C EUR acc-	LU1965940510	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-C USD acc-	LU1900873875	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-C USD dist-	LU1900873958	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-I CHF acc-	LU1965941161	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-I EUR acc-	LU1965940940	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-I USD acc-	LU1900874097	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-I10 USD acc-	LU2273125992	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-P CHF acc-	LU1965940353	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-P CHF dist-	LU1965940437	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-P EUR acc-	LU1965940197	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-P USD acc-	LU1900873529	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-P USD dist-	LU1900873792	MSCI China All Shares NR Index

* Siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

Total Expense Ratio per 30.06.2023

	ISIN-Nummer	TER mit Performance-gebühr	% der Performance-gebühr
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C CHF acc hedged-	LU1073944271	1.18	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C EUR acc hedged-	LU1073944354	1.18	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C USD acc-	LU1073944198	1.18	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C USD dist-	LU1210450364	1.18	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I CHF acc hedged-	LU1073944511	1.10	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I USD acc-	LU1073944438	0.99	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I USD dist-	LU1210450448	0.99	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P CHF acc hedged-	LU1073943893	1.63	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P EUR acc hedged-	LU1073943976	1.63	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P EUR dist hedged-	LU1244594351	1.63	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P USD acc-	LU1073943620	1.63	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P USD dist-	LU1210450281	1.63	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y CHF acc hedged-	LU1201473821	0.83	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y CHF dist hedged-	LU1244594948	0.83	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y EUR acc hedged-	LU1201474043	0.83	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y EUR dist hedged-	LU1244595085	0.83	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y GBP dist hedged-	LU1545798859	0.83	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y USD acc-	LU1201474126	0.83	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y USD dist-	LU1210450521	0.83	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -C USD acc-	LU0950588334	1.37	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -C USD dist-	LU1732170136	1.37	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -I USD acc-	LU1111702400	1.08	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -M USD acc-	LU1860229043	0.32	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -P USD dist-	LU0068337053	1.87	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C EUR acc-	LU0950588763	1.29	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C EUR dist-	LU1732170649	1.30	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C GBP acc-	LU1354468743	1.27	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C H1 GBP dist-	LU2592797984	1.28	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C USD acc-	LU1111702822	1.29	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C USD dist-	LU2076226567	1.30	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -E USD acc-	LU2076227615	1.59	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -E USD dist-	LU2076227532	1.58	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -I USD acc-	LU1111703044	1.00	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -I10 EUR acc-	LU2569393635	0.85	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -M USD acc-	LU2076228340	0.25	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P EUR acc-	LU0533812276	1.79	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P EUR dist-	LU0375216479	1.79	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P USD acc-	LU1096892549	1.79	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P USD dist-	LU1732170565	1.78	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -S EUR acc-	LU1842717297	1.04	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -S EUR dist-	LU1842717370	1.04	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y EUR dist-	LU2076227706	0.89	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y USD acc-	LU2076228001	0.89	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y USD dist-	LU2076227961	0.89	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) -C CHF acc-	LU0950588920	1.30	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) -C CHF dist-	LU1732170995	1.30	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) -P CHF dist-	LU0058890657	1.80	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -C EUR acc-	LU0950589068	1.32	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -C EUR dist-	LU1732171027	1.33	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -P EUR dist-	LU0058893917	1.83	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -S EUR acc-	LU1842716646	1.08	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR) -P EUR acc-	LU0198388380	1.91	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C CHF acc hedged-	LU1111708860	1.22	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C EUR acc-	LU1111708787	1.22	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C GBP acc hedged-	LU1111709082	1.22	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C USD acc hedged-	LU1111708944	1.22	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I CHF acc hedged-	LU1111709322	0.66	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I EUR acc-	LU1111709249	0.66	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I USD acc hedged-	LU1111709595	0.66	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I USD dist hedged-	LU1244595754	0.59	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I10 CHF acc hedged-	LU2075973177	0.61	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I10 EUR acc-	LU2075973334	0.61	-

* Siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

Total Expense Ratio per 30.06.2023

	ISIN-Nummer	TER mit Performance-gebühr	% der Performance-gebühr
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I3 CHF acc hedged-	LU2075972286	0.66	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 CHF acc hedged-	LU1629314078	0.56	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 EUR acc-	LU1629313856	0.56	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 EUR dist-	LU1629313930	0.70	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 GBP dist hedged-	LU1629314581	0.57	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 USD acc hedged-	LU1629314235	0.62	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 USD dist hedged-	LU1629314318	0.55	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 CHF acc hedged-	LU2075975206	0.66	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 EUR acc-	LU2075975461	0.66	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 EUR dist-	LU2075975545	0.66	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 USD acc hedged-	LU2075977087	0.61	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 CHF acc hedged-	LU2075976600	0.61	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 GBP acc hedged-	LU2075977327	0.61	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P CHF acc hedged-	LU1111708431	1.32	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P EUR acc-	LU1111708357	1.32	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P EUR dist-	LU1210451099	1.32	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P USD acc hedged-	LU1111708514	1.32	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P USD dist hedged-	LU1244595242	1.32	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C CHF acc-	LU2076229074	1.54	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C EUR acc-	LU0950589498	1.54	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C EUR dist-	LU1732171373	1.54	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C GBP acc-	LU2076229405	1.52	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C USD acc-	LU1111703127	1.54	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I EUR acc-	LU0405184523	1.40	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD (BRL hedged) acc-	LU2067136072	1.06	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD acc-	LU1111703390	1.40	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD dist-	LU1991390706	1.40	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 CHF acc-	LU2008796604	0.81	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 EUR acc-	LU2008796273	0.90	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 USD acc-	LU2008796430	0.90	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I30 CHF acc-	LU2427699371	0.83	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -IH1 NOK acc-	LU2076230247	1.40	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -M CHF acc-	LU2499280977	0.38	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -M EUR acc-	LU0950589571	0.37	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P EUR acc-	LU0480508919	2.04	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P EUR dist-	LU0229773345	2.04	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P SGD acc-	LU2361429579	2.04	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P USD acc-	LU1111703473	2.04	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P USD dist-	LU1732171290	2.03	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -S EUR dist-	LU2076230833	1.04	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -Y EUR acc-	LU1205684001	0.89	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -Y USD dist-	LU2161043588	0.89	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C CHF acc hedged-	LU1073945245	1.00	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C EUR acc hedged-	LU1073945328	1.00	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C EUR dist hedged-	LU1244596133	0.97	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C USD acc-	LU1073945161	0.99	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C USD dist-	LU1210452063	0.99	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -I USD acc-	LU1073945591	0.86	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P CHF acc hedged-	LU1073944941	1.09	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P EUR acc hedged-	LU1073945088	1.11	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P USD acc-	LU1073944867	1.09	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P USD dist-	LU1210451842	1.09	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y CHF acc hedged-	LU1201473581	0.69	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y EUR acc hedged-	LU1201473664	0.69	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y USD dist-	LU1210452659	0.70	-
JSS Sustainable Bond CHF -C CHF acc-	LU0950591809	0.84	-
JSS Sustainable Bond CHF -M CHF acc-	LU0950591981	0.44	-
JSS Sustainable Bond CHF -P CHF dist-	LU0121751324	1.08	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C CHF acc hedged-	LU2076224786	0.76	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C EUR acc-	LU0950592104	0.76	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C EUR dist-	LU1732171969	0.76	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -I EUR acc-	LU2076225163	0.49	-

* Siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

Total Expense Ratio per 30.06.2023

	ISIN-Nummer	TER mit Performancegebühr	% der Performancegebühr
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P CHF dist hedged-	LU2076224273	1.00	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P EUR acc-	LU2076223622	1.01	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P EUR dist-	LU0158938935	1.00	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y CHF acc hedged-	LU2076226054	0.64	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y EUR acc-	LU1752454568	0.65	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y EUR dist-	LU1752454485	0.66	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -C EUR acc-	LU0950591718	0.81	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -C EUR dist-	LU1732172009	0.81	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -I EUR acc-	LU0734492860	0.67	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -M EUR acc-	LU0776582891	0.37	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -P EUR dist-	LU0045164786	1.06	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -Y CHF dist hedged-	LU2312587103	0.66	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -Y EUR acc-	LU1205683706	0.66	-
JSS Sustainable Equity - Europe -C EUR acc-	LU0950592369	1.34	-
JSS Sustainable Equity - Europe -P EUR acc-	LU0484532444	1.69	-
JSS Sustainable Equity - Europe -P EUR dist-	LU0058891119	1.69	-
JSS Sustainable Equity - Europe -P USD acc-	LU1096900078	1.69	-
JSS Sustainable Equity - Europe -Y EUR acc-	LU1205683888	0.74	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C CHF acc-	LU2273127774	1.30	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C EUR acc-	LU0950592443	1.30	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C USD acc-	LU1111704364	1.30	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -I CHF acc-	LU2273128319	1.05	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -I EUR acc-	LU1111704521	1.08	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -M CHF acc-	LU2499280894	0.27	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -M EUR acc-	LU0749004452	0.25	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -P EUR dist-	LU0097427784	1.80	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -P USD acc-	LU1111704448	1.80	-
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -C EUR acc-	LU0950592872	1.35	-
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -C EUR dist-	LU1991392827	1.35	-
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -I EUR acc-	LU0950592955	1.20	-
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P EUR acc-	LU0288928376	1.85	-
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P EUR dist-	LU1991392074	1.84	-
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P USD acc-	LU1111705098	1.84	-
JSS Sustainable Equity - USA -C USD acc-	LU0950593094	1.28	-
JSS Sustainable Equity - USA -I USD acc-	LU1111705254	1.02	-
JSS Sustainable Equity - USA -I USD dist-	LU2076232961	0.95	-
JSS Sustainable Equity - USA -I10 USD acc-	LU2427700138	0.85	-
JSS Sustainable Equity - USA -P USD acc-	LU0526864581	1.69	-
JSS Sustainable Equity - USA -P USD dist-	LU2076232706	1.69	-
JSS Sustainable Equity - USA -Y USD acc-	LU1629314664	0.69	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C EUR acc-	LU0950593177	1.25	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I EUR acc-	LU1842720168	0.91	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I EUR dist-	LU1842720242	0.90	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I H2 CHF dist-	LU2273130562	0.89	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I USD H2 acc-	LU1842720325	0.90	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P CHF H2 acc-	LU1111702079	1.72	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P EUR acc-	LU1111705338	1.72	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P EUR dist-	LU0058892943	1.72	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P USD H2 acc-	LU1842719665	1.72	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C CHF H1 acc-	LU1111702236	1.64	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C EUR acc-	LU0950593250	1.64	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C EUR dist-	LU1732172694	1.64	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C USD acc-	LU1111705684	1.64	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C USD dist-	LU1732172777	1.64	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I CHF acc-	LU1965939850	1.06	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I EUR acc-	LU0333595519	1.06	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I EUR dist-	LU1732172850	1.05	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I10 EUR acc-	LU2427703074	0.98	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P CHF H1 acc -	LU1111702319	2.04	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P EUR acc-	LU0707700596	2.04	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P EUR dist-	LU0333595436	2.04	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P GBP dist-	LU1545800341	2.03	-

* Siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

Total Expense Ratio per 30.06.2023

	ISIN-Nummer	TER mit Performancegebühr	% der Performancegebühr
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P USD H1 acc-	LU1120832198	2.04	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P USD dist-	LU0950593417	2.04	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -S EUR dist-	LU1842716729	1.29	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -Y EUR acc-	LU1205684183	0.89	-
JSS Bond - USD High Yield -C EUR acc hedged-	LU1184841341	1.42	-
JSS Bond - USD High Yield -C USD acc-	LU1184840962	1.42	-
JSS Bond - USD High Yield -C USD dist-	LU1210450109	1.42	-
JSS Bond - USD High Yield -I CHF acc hedged-	LU1184841937	1.23	-
JSS Bond - USD High Yield -I USD acc-	LU1184841770	1.18	-
JSS Bond - USD High Yield -I USD dist-	LU1210450018	1.18	-
JSS Bond - USD High Yield -P CHF acc hedged-	LU1184840293	1.72	-
JSS Bond - USD High Yield -P CHF dist hedged-	LU1184840459	1.73	-
JSS Bond - USD High Yield -P EUR acc hedged-	LU1184840533	1.72	-
JSS Bond - USD High Yield -P EUR dist hedged-	LU1184840707	1.72	-
JSS Bond - USD High Yield -P USD acc-	LU1184840020	1.72	-
JSS Bond - USD High Yield -P USD dist-	LU1210449945	1.72	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C CHF acc hedged-	LU1332517405	0.94	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C EUR acc hedged-	LU1332517660	0.94	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C USD acc-	LU1332517231	0.94	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C USD dist-	LU1332517314	0.94	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I CHF acc hedged-	LU1332518122	0.75	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I EUR acc hedged-	LU1332518478	0.76	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I EUR dist hedged-	LU1332518551	0.75	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I USD acc-	LU1332517827	0.75	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I USD dist-	LU1332518049	0.75	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -M CHF acc hedged-	LU1332518635	0.37	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P CHF acc hedged-	LU1332516852	1.29	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P EUR acc hedged-	LU1332517074	1.30	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P EUR dist hedged-	LU1332517157	1.29	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P USD acc-	LU1332516696	1.29	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P USD dist-	LU1332516779	1.29	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y CHF acc hedged-	LU1405747244	0.64	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y EUR acc hedged-	LU1405747327	0.64	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y GBP dist hedged-	LU1405749539	0.64	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y USD acc-	LU1405747087	0.64	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y USD dist-	LU1405747160	0.64	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C EUR acc-	LU1752455532	1.63	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C EUR dist-	LU1752455615	1.63	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C USD acc-	LU1752455375	1.63	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -E EUR acc-	LU2161045799	1.83	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -E EUR dist-	LU2161045872	1.78	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -I USD acc-	LU1752455888	1.12	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P EUR acc-	LU1752454998	2.24	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P EUR dist-	LU1752455292	2.22	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P USD acc-	LU1752454642	2.22	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P USD dist-	LU1752454725	2.23	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -Y USD acc-	LU1752456001	1.01	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -Y USD dist-	LU1752456266	1.01	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C CHF acc-	LU1842718345	1.29	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C EUR acc-	LU1752457405	1.29	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C USD acc-	LU1752456936	1.29	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C USD dist-	LU1752457157	1.29	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -E USD acc-	LU1842717453	1.59	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -E USD dist-	LU1842717537	1.59	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I CHF acc-	LU1842718691	1.05	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I EUR acc-	LU2076231567	1.03	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I USD (BRL hedged) acc-	LU1842717883	1.11	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I USD acc-	LU1752458551	1.05	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I10 USD acc-	LU2273126701	0.95	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -M USD acc-	LU1842718006	0.35	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P CHF dist-	LU1842718261	1.89	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P EUR acc-	LU1752456696	1.88	-

* Siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

Total Expense Ratio per 30.06.2023

	ISIN-Nummer	TER mit Performance- gebühr	% der Performance- gebühr
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P EUR dist-	LU1752456852	1.89	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P USD acc-	LU1752456340	1.89	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P USD dist-	LU1752456423	1.89	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -Y USD acc-	LU1752458049	0.86	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -Y USD dist-	LU1752458478	0.86	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -C USD acc-	LU1835934479	1.40	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -C USD dist-	LU1835934552	1.40	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -I USD acc-	LU1835934636	0.87	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -I USD dist-	LU1835934719	0.87	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -M USD acc-	LU1835935013	0.48	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -P USD acc-	LU1835934123	1.90	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -P USD dist-	LU1835934396	1.90	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -Y USD acc-	LU1835934800	0.90	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -Y USD dist-	LU1835934982	0.90	-
JSS Equity - All China -C CHF acc-	LU1965940783	1.59	-
JSS Equity - All China -C EUR acc-	LU1965940510	1.59	-
JSS Equity - All China -C USD acc-	LU1900873875	1.59	-
JSS Equity - All China -C USD dist-	LU1900873958	1.59	-
JSS Equity - All China -I CHF acc-	LU1965941161	1.24	-
JSS Equity - All China -I EUR acc-	LU1965940940	1.24	-
JSS Equity - All China -I USD acc-	LU1900874097	1.24	-
JSS Equity - All China -I10 USD acc-	LU2273125992	1.14	-
JSS Equity - All China -P CHF acc-	LU1965940353	1.99	-
JSS Equity - All China -P CHF dist-	LU1965940437	1.99	-
JSS Equity - All China -P EUR acc-	LU1965940197	1.99	-
JSS Equity - All China -P USD acc-	LU1900873529	1.99	-
JSS Equity - All China -P USD dist-	LU1900873792	1.99	-

* Siehe Erläuterung 17

Organisation und Verwaltung

Eingetragener Sitz der Gesellschaft

11-13, Boulevard de la Foire,
L-1528 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft

J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A.,
11-13, Boulevard de la Foire,
L-1528 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsrat der Gesellschaft

Urs Oberer (Präsident),
Geschäftsführer,
Bank J. Safra Sarasin AG,
Basel, Schweiz

Jules Ronald Moor,
Geschäftsführer (CEO Luxembourg),
Banque J. Safra Sarasin (Luxembourg) S.A.,
Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Ronnie Neefs
Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Claude Niedner,
Partner,
Arendt & Medernach S.A.,
Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Geschäftsleitung der Verwaltungsgesellschaft

Leonardo Mattos,
Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Valter Rinaldi,
Basel, Schweiz

Ronnie Neefs,
Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter

Bank J. Safra Sarasin AG,

Elisabethenstrasse 62,
CH-4051 Basel, Schweiz

Verwaltete Teilfonds:

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets,
JSS Sustainable Equity - Global Dividend,
JSS Sustainable Bond CHF,
JSS Sustainable Bond - Euro Broad,
JSS Sustainable Bond EUR Corporates,
JSS Sustainable Equity - Europe,
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035,
JSS Sustainable Equity - USA,
JSS Sustainable Equity - Green Planet,
JSS Sustainable Bond - Total Return Global,
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities,
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer,
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors,
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency,
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG,
JSS Sustainable Bond - Global Short-term.

Sarasin & Partners LLP,

Juxon House, 100 St. Paul's Churchyard,
London EC4M 8BU, Vereinigtes Königreich

Verwaltete Teilfonds:

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR),
JSS Sustainable Equity - Global Thematic,
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global,
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF),
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR).

Twelve Capital AG

Dufourstrasse 101,
CH-8008 Zürich, Schweiz

Verwaltete Teilfonds:

JSS Twelve Sustainable Insurance Bond.

Federated Investment Counseling

1001 Liberty Avenue,
Pittsburgh, PA 15222,
Pennsylvania, Vereinigte Staaten von Amerika

Verwaltete Teilfonds:

JSS Bond - USD High Yield.

China Asset Management Co. Ltd.

Zone A, Tianzhu Airport Industrial Zone,
Shunyi District,
Peking,

Volksrepublik China

Verwaltete Teilfonds:

JSS Equity - All China

Organisation und Verwaltung (Fortsetzung)

Verwahrstelle & Zahlstelle

RBC Investor Services Bank S.A.,
14, Porte de France
L-4360 Esch-sur-Alzette
Großherzogtum Luxemburg

Zentralverwaltung, Domizil-, Register- und Transferstelle

RBC Investor Services Bank S.A.,
14, Porte de France
L-4360 Esch-sur-Alzette
Großherzogtum Luxemburg

Zahlstelle für die Schweiz

Bank J. Safra Sarasin AG,
Elisabethenstrasse 62,
CH-4002 Basel, Schweiz

Vertreter in der Schweiz

J. Safra Sarasin Investmentfonds AG,
Wallstrasse 9,
CH-4002 Basel, Schweiz

Italienische Zahlstellen

State Street S.p.A.,
Via Ferrante Aporti, 10,
I-20125 Mailand, Italien

Société Générale Securities Services S.p.A.,
Via Benigno Crespi 19/A - MAC2,
I-20159 Mailand, Italien

Allfunds Bank S.A., Italian Branch,
Via Santa Margherita, 7
I-20121 Mailand, Italien

Zentralisierungsstelle in Frankreich

Caceis Bank France S.A.
1-3, Place Valhubert,
F-75013 Paris, Frankreich

Informationsstelle in Gibraltar

Bank J. Safra Sarasin (Gibraltar) Ltd.
57/63 Line Wall Road
P.O. Box 452, Gibraltar

Facility Agent und Zahlstelle in Großbritannien

Sarasin & Partners LLP,
Juxon House, 100 St. Paul's Churchyard,
London EC4M 8BU, Großbritannien

Zahlstelle in Schweden

SEB Skandinaviska Enskilda Banken AG,
Merchant Banking,
SE-10640 Stockholm, Schweden

Cabinet de révision agréé

Deloitte Audit,
Société à responsabilité limitée,
20, Boulevard de Kockelscheuer,
L-1821 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater

Arendt & Medernach S.A.,
41A, avenue J.F Kennedy,
L-2082 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Nettoinventarwertaufstellung

Nettoinventarwertaufstellung

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C CHF acc hedged- LU1073944271			
Nettovermögen	236 696.70	232 947.71	374 022.31
Nettoinventarwert pro Aktie	81.15	82.70	99.11
Im Umlauf befindliche Aktien	2 916.78	2 816.78	3 773.81
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C EUR acc hedged- LU1073944354			
Nettovermögen	177 452.45	149 841.24	379 660.80
Nettoinventarwert pro Aktie	82.16	82.93	99.21
Im Umlauf befindliche Aktien	2 159.84	1 806.84	3 826.84
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C USD acc- LU1073944198			
Nettovermögen	4 855 260.09	5 348 950.51	7 046 571.68
Nettoinventarwert pro Aktie	113.02	110.81	130.99
Im Umlauf befindliche Aktien	42 959.30	48 271.37	53 794.73
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C USD dist- LU1210450364			
Nettovermögen	5 693 192.56	6 142 307.32	7 406 352.45
Nettoinventarwert pro Aktie	88.72	89.76	109.21
Im Umlauf befindliche Aktien	64 170.34	68 430.34	67 817.53
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I CHF acc hedged- LU1073944511			
Nettovermögen	-	3 909 120.00	8 893 536.14
Nettoinventarwert pro Aktie	-	81.44	97.48
Im Umlauf befindliche Aktien	-	48 000.00	91 234.47
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I USD acc- LU1073944438			
Nettovermögen	149 749 914.79	155 342 446.64	200 617 774.78
Nettoinventarwert pro Aktie	115.16	112.70	132.97
Im Umlauf befindliche Aktien	1 300 363.97	1 378 371.31	1 508 744.64
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I USD dist- LU1210450448			
Nettovermögen	6 369 063.63	8 855 326.13	23 356 849.31
Nettoinventarwert pro Aktie	86.28	87.30	106.25
Im Umlauf befindliche Aktien	73 818.54	101 435.58	219 829.17
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P CHF acc hedged- LU1073943893			
Nettovermögen	2 880 454.09	3 058 591.44	2 877 537.09
Nettoinventarwert pro Aktie	75.96	77.77	93.62
Im Umlauf befindliche Aktien	37 920.67	39 328.68	30 736.35
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P EUR acc hedged- LU1073943976			
Nettovermögen	9 363 509.00	10 087 627.48	12 451 539.70
Nettoinventarwert pro Aktie	73.79	74.80	89.91
Im Umlauf befindliche Aktien	126 894.01	134 861.33	138 488.93
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P EUR dist hedged- LU1244594351			
Nettovermögen	641 543.80	668 790.84	1 275 133.31
Nettoinventarwert pro Aktie	75.11	78.30	96.53
Im Umlauf befindliche Aktien	8 541.39	8 541.39	13 209.71
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P USD acc- LU1073943620			
Nettovermögen	53 295 788.75	60 619 004.64	86 594 384.18
Nettoinventarwert pro Aktie	108.86	107.22	127.31
Im Umlauf befindliche Aktien	489 581.01	565 370.31	680 185.25
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P USD dist- LU1210450281			
Nettovermögen	17 571 906.76	19 105 492.68	26 223 816.30
Nettoinventarwert pro Aktie	88.35	89.37	108.70
Im Umlauf befindliche Aktien	198 889.72	213 779.71	241 249.46

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y CHF acc hedged- LU1201473821			
Nettovermögen	26 209 814.83	33 939 048.75	36 141 005.04
Nettoinventarwert pro Aktie	81.15	82.41	98.42
Im Umlauf befindliche Aktien	322 979.85	411 831.68	367 212.00
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y CHF dist hedged- LU1244594948			
Nettovermögen	2 303 464.06	3 101 706.87	3 233 323.60
Nettoinventarwert pro Aktie	76.39	80.44	98.79
Im Umlauf befindliche Aktien	30 154.00	38 559.26	32 729.26
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y EUR acc hedged- LU1201474043			
Nettovermögen	40 869 945.96	44 894 927.63	45 570 546.12
Nettoinventarwert pro Aktie	78.85	79.31	94.54
Im Umlauf befindliche Aktien	518 325.25	566 068.94	482 023.97
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y EUR dist hedged- LU1244595085			
Nettovermögen	629 261.50	612 256.00	1 928 355.00
Nettoinventarwert pro Aktie	77.21	80.56	98.89
Im Umlauf befindliche Aktien	8 150.00	7 600.00	19 500.00
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y GBP dist hedged- LU1545798859			
Nettovermögen	5 097 029.74	4 508 423.11	5 216 801.14
Nettoinventarwert pro Aktie	79.45	81.53	99.09
Im Umlauf befindliche Aktien	64 153.93	55 297.72	52 647.10
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y USD acc- LU1201474126			
Nettovermögen	2 393 686.60	3 770 007.00	3 548 360.88
Nettoinventarwert pro Aktie	116.30	113.64	133.86
Im Umlauf befindliche Aktien	20 582.00	33 175.00	26 508.00
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y USD dist- LU1210450521			
Nettovermögen	48 882 079.19	59 794 094.59	54 905 112.91
Nettoinventarwert pro Aktie	81.25	82.22	99.58
Im Umlauf befindliche Aktien	601 625.59	727 245.13	551 366.87
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -C USD acc- LU0950588334			
Nettovermögen	785 417.61	864 552.64	1 387 408.79
Nettoinventarwert pro Aktie	257.71	266.18	387.80
Im Umlauf befindliche Aktien	3 047.68	3 248.00	3 577.64
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -C USD dist- LU1732170136			
Nettovermögen	516 140.89	540 248.81	1 223 878.72
Nettoinventarwert pro Aktie	69.66	71.95	104.83
Im Umlauf befindliche Aktien	7 409.43	7 508.67	11 674.89
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -I USD acc- LU1111702400			
Nettovermögen	10 579 347.04	9 249 455.52	-
Nettoinventarwert pro Aktie	67.46	69.48	-
Im Umlauf befindliche Aktien	156 824.00	133 124.00	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -M USD acc- LU1860229043			
Nettovermögen	1 930 690.00	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	94.18	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	20 500.00	-	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -P USD dist- LU0068337053			
Nettovermögen	26 729 237.39	29 420 041.67	48 652 862.39
Nettoinventarwert pro Aktie	244.91	254.22	372.24
Im Umlauf befindliche Aktien	109 139.02	115 726.70	130 702.94

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C EUR acc- LU0950588763			
Nettovermögen	11 331 754.10	10 257 113.64	2 266 538.60
Nettoinventarwert pro Aktie	136.97	125.59	121.18
Im Umlauf befindliche Aktien	82 731.65	81 671.42	18 703.90
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C EUR dist- LU1732170649			
Nettovermögen	6 955 618.07	2 987 789.42	840 714.51
Nettoinventarwert pro Aktie	134.31	124.62	121.42
Im Umlauf befindliche Aktien	51 787.79	23 975.20	6 924.02
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C GBP acc- LU1354468743			
Nettovermögen	500 750.00	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	100.15	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	5 000.00	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C H1 GBP dist- LU2592797984			
Nettovermögen	1 032 200.00	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	103.22	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	10 000.00	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C USD acc- LU1111702822			
Nettovermögen	7 438 954.71	7 843 358.45	2 252 816.48
Nettoinventarwert pro Aktie	123.01	108.09	118.30
Im Umlauf befindliche Aktien	60 474.39	72 563.22	19 043.25
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C USD dist- LU2076226567			
Nettovermögen	1 626 481.43	779 416.07	404 561.01
Nettoinventarwert pro Aktie	112.66	100.16	109.63
Im Umlauf befindliche Aktien	14 437.08	7 781.71	3 690.24
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -E USD acc- LU2076227615			
Nettovermögen	3 322 351.51	3 982 416.63	4 797 923.49
Nettoinventarwert pro Aktie	132.77	117.01	128.45
Im Umlauf befindliche Aktien	25 023.36	34 034.84	37 352.46
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -E USD dist- LU2076227532			
Nettovermögen	2 087 532.00	5 217 464.88	5 776 982.97
Nettoinventarwert pro Aktie	131.83	116.18	127.54
Im Umlauf befindliche Aktien	15 835.03	44 908.46	45 295.46
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -I USD acc- LU1111703044			
Nettovermögen	10 354 475.28	261 957.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	103.10	90.33	-
Im Umlauf befindliche Aktien	100 431.38	2 900.00	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -I10 EUR acc- LU2569393635			
Nettovermögen	10 862 774.52	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	102.19	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	106 299.78	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -M USD acc- LU2076228340			
Nettovermögen	33 415 657.50	23 256 074.40	-
Nettoinventarwert pro Aktie	104.05	90.48	-
Im Umlauf befindliche Aktien	321 150.00	257 030.00	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P EUR acc- LU0533812276			
Nettovermögen	20 896 891.19	14 691 789.48	11 792 101.83
Nettoinventarwert pro Aktie	295.67	272.47	264.21
Im Umlauf befindliche Aktien	70 676.40	53 920.76	44 631.55

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P EUR dist- LU0375216479			
Nettovermögen	8 852 598.46	8 173 382.08	6 304 015.72
Nettoinventarwert pro Aktie	256.49	237.79	231.82
Im Umlauf befindliche Aktien	34 514.40	34 372.27	27 193.58
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P USD acc- LU1096892549			
Nettovermögen	31 136 233.76	36 253 295.32	28 151 199.65
Nettoinventarwert pro Aktie	322.57	284.85	313.33
Im Umlauf befindliche Aktien	96 525.51	127 271.53	89 845.21
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P USD dist- LU1732170565			
Nettovermögen	5 407 564.83	6 635 233.22	2 982 819.89
Nettoinventarwert pro Aktie	108.54	95.84	105.42
Im Umlauf befindliche Aktien	49 820.94	69 232.40	28 294.63
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -S EUR acc- LU1842717297			
Nettovermögen	1 654 075.32	1 517 445.25	1 894 373.98
Nettoinventarwert pro Aktie	150.41	137.57	132.41
Im Umlauf befindliche Aktien	10 997.11	11 030.35	14 306.88
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -S EUR dist- LU1842717370			
Nettovermögen	3 162 041.73	3 219 065.11	3 435 656.41
Nettoinventarwert pro Aktie	142.41	132.17	128.75
Im Umlauf befindliche Aktien	22 203.79	24 355.49	26 684.71
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y EUR dist- LU2076227706			
Nettovermögen	1 319 220.00	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	104.70	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	12 600.00	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y USD acc- LU2076228001			
Nettovermögen	87 644 244.74	65 590 956.03	31 752 065.26
Nettoinventarwert pro Aktie	142.10	124.36	135.57
Im Umlauf befindliche Aktien	616 778.64	527 428.08	234 211.59
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y USD dist- LU2076227961			
Nettovermögen	83 662 273.75	31 608 484.93	19 806 729.34
Nettoinventarwert pro Aktie	165.10	146.88	162.26
Im Umlauf befindliche Aktien	506 736.97	215 199.38	122 067.85
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) -C CHF acc- LU0950588920			
Nettovermögen	8 504 177.97	9 607 991.61	13 657 546.22
Nettoinventarwert pro Aktie	404.75	408.31	502.79
Im Umlauf befindliche Aktien	21 010.94	23 531.12	27 163.52
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) -C CHF dist- LU1732170995			
Nettovermögen	4 104 759.30	4 282 086.81	5 138 511.64
Nettoinventarwert pro Aktie	96.27	97.11	119.58
Im Umlauf befindliche Aktien	42 637.99	44 095.22	42 971.33
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) -P CHF dist- LU0058890657			
Nettovermögen	106 230 465.59	128 964 955.34	167 659 891.74
Nettoinventarwert pro Aktie	421.41	427.25	528.73
Im Umlauf befindliche Aktien	252 083.40	301 848.93	317 099.26
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -C EUR acc- LU0950589068			
Nettovermögen	9 446 825.84	15 074 842.94	20 948 347.18
Nettoinventarwert pro Aktie	384.52	382.73	454.37
Im Umlauf befindliche Aktien	24 567.84	39 387.67	46 104.16

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -C EUR dist- LU1732171027			
Nettovermögen	1 042 694.82	884 446.54	1 064 782.85
Nettoinventarwert pro Aktie	89.02	88.61	105.20
Im Umlauf befindliche Aktien	11 713.04	9 981.34	10 121.51
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -P EUR dist- LU0058893917			
Nettovermögen	36 575 711.74	40 712 522.64	51 672 706.00
Nettoinventarwert pro Aktie	363.07	363.20	433.35
Im Umlauf befindliche Aktien	100 740.11	112 093.95	119 240.12
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -S EUR acc- LU1842716646			
Nettovermögen	333 607.98	331 261.09	490 067.20
Nettoinventarwert pro Aktie	105.19	104.45	123.69
Im Umlauf befindliche Aktien	3 171.48	3 171.48	3 962.06
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR) -P EUR acc- LU0198388380			
Nettovermögen	19 951 731.81	21 571 270.66	27 033 781.61
Nettoinventarwert pro Aktie	205.81	199.22	236.33
Im Umlauf befindliche Aktien	96 942.48	108 278.64	114 389.97
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C CHF acc hedged- LU1111708860			
Nettovermögen	8 264 418.83	1 879 495.97	1 535 114.20
Nettoinventarwert pro Aktie	123.49	125.03	143.37
Im Umlauf befindliche Aktien	66 923.79	15 032.36	10 707.36
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C EUR acc- LU1111708787			
Nettovermögen	5 316 336.27	5 671 515.74	6 486 590.53
Nettoinventarwert pro Aktie	108.56	108.35	123.82
Im Umlauf befindliche Aktien	48 971.41	52 344.40	52 387.26
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C GBP acc hedged- LU1111709082			
Nettovermögen	463 753.56	863 235.48	1 023 861.82
Nettoinventarwert pro Aktie	84.12	82.86	94.02
Im Umlauf befindliche Aktien	5 513.00	10 418.00	10 889.83
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C USD acc hedged- LU1111708944			
Nettovermögen	2 538 702.69	3 283 592.66	3 833 521.63
Nettoinventarwert pro Aktie	153.18	149.42	169.32
Im Umlauf befindliche Aktien	16 573.33	21 975.59	22 640.69
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I CHF acc hedged- LU1111709322			
Nettovermögen	20 067 178.42	21 735 277.74	31 990 800.99
Nettoinventarwert pro Aktie	126.03	126.86	144.74
Im Umlauf befindliche Aktien	159 225.41	171 332.79	221 022.53
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I EUR acc- LU1111709249			
Nettovermögen	34 037 550.93	25 262 906.06	13 597 220.48
Nettoinventarwert pro Aktie	111.21	110.37	125.49
Im Umlauf befindliche Aktien	306 065.56	228 892.87	108 353.02
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I USD acc hedged- LU1111709595			
Nettovermögen	3 612 268.19	3 810 061.27	4 838 257.90
Nettoinventarwert pro Aktie	158.01	153.29	172.87
Im Umlauf befindliche Aktien	22 861.01	24 855.25	27 987.84
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I USD dist hedged- LU1244595754			
Nettovermögen	4 447 746.10	4 472 125.81	5 161 406.77
Nettoinventarwert pro Aktie	100.34	100.89	116.44
Im Umlauf befindliche Aktien	44 326.75	44 326.75	44 326.75

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I10 CHF acc hedged- LU2075973177			
Nettovermögen	29 640 548.49	25 804 122.26	45 455 287.31
Nettoinventarwert pro Aktie	99.89	100.51	114.58
Im Umlauf befindliche Aktien	296 731.89	256 731.89	396 712.23
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I10 EUR acc- LU2075973334			
Nettovermögen	53 192 272.26	27 353 367.10	30 682 890.35
Nettoinventarwert pro Aktie	90.82	90.10	102.35
Im Umlauf befindliche Aktien	585 688.97	303 588.98	299 783.98
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I3 CHF acc hedged- LU2075972286			
Nettovermögen	5 309 999.62	5 345 329.31	6 096 217.04
Nettoinventarwert pro Aktie	100.70	101.37	115.61
Im Umlauf befindliche Aktien	52 730.88	52 730.88	52 730.88
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 CHF acc hedged- LU1629314078			
Nettovermögen	49 151 261.26	47 033 871.13	60 559 223.28
Nettoinventarwert pro Aktie	98.35	98.91	112.70
Im Umlauf befindliche Aktien	499 758.63	475 521.90	537 348.92
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 EUR acc- LU1629313856			
Nettovermögen	109 826 126.27	80 758 247.98	95 507 205.16
Nettoinventarwert pro Aktie	99.97	99.12	112.55
Im Umlauf befindliche Aktien	1 098 590.84	814 752.30	848 575.79
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 EUR dist- LU1629313930			
Nettovermögen	-	1 880 030.90	5 297 898.80
Nettoinventarwert pro Aktie	-	93.14	109.19
Im Umlauf befindliche Aktien	-	20 185.00	48 520.00
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 GBP dist hedged- LU1629314581			
Nettovermögen	14 873.46	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	101.18	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	147.00	-	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 USD acc hedged- LU1629314235			
Nettovermögen	-	70 640.40	32 353 609.20
Nettoinventarwert pro Aktie	-	95.46	107.58
Im Umlauf befindliche Aktien	-	740.00	300 740.00
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 USD dist hedged- LU1629314318			
Nettovermögen	-	23 535 407.92	45 681 748.08
Nettoinventarwert pro Aktie	-	95.92	111.43
Im Umlauf befindliche Aktien	-	245 364.97	409 959.15
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 CHF acc hedged- LU2075975206			
Nettovermögen	9 147 805.24	20 572 047.30	18 254 130.97
Nettoinventarwert pro Aktie	97.35	98.00	111.79
Im Umlauf befindliche Aktien	93 968.21	209 918.85	163 289.48
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 EUR acc- LU2075975461			
Nettovermögen	4 627 935.45	4 290 790.04	5 424 672.62
Nettoinventarwert pro Aktie	99.51	98.77	112.26
Im Umlauf befindliche Aktien	46 507.24	43 442.24	48 322.40
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 EUR dist- LU2075975545			
Nettovermögen	6 342 942.26	6 147 072.00	5 175 595.00
Nettoinventarwert pro Aktie	89.06	92.16	108.05
Im Umlauf befindliche Aktien	71 221.00	66 700.00	47 900.00

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 USD acc hedged- LU2075977087			
Nettovermögen	6 780 340.00	6 572 195.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	101.96	98.83	-
Im Umlauf befindliche Aktien	66 500.00	66 500.00	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 CHF acc hedged- LU2075976600			
Nettovermögen	7 981 878.41	7 533 910.81	-
Nettoinventarwert pro Aktie	98.30	98.87	-
Im Umlauf befindliche Aktien	81 199.17	76 200.17	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 GBP acc hedged- LU2075977327			
Nettovermögen	1 157 328.00	1 132 932.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	101.52	99.38	-
Im Umlauf befindliche Aktien	11 400.00	11 400.00	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P CHF acc hedged- LU1111708431			
Nettovermögen	12 546 093.04	15 111 631.19	19 870 584.09
Nettoinventarwert pro Aktie	121.80	123.42	141.65
Im Umlauf befindliche Aktien	103 005.69	122 440.70	140 279.45
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P EUR acc- LU1111708357			
Nettovermögen	17 458 734.96	23 999 528.66	32 955 671.11
Nettoinventarwert pro Aktie	107.32	107.22	122.65
Im Umlauf befindliche Aktien	162 679.23	223 834.44	268 696.87
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P EUR dist- LU1210451099			
Nettovermögen	4 060 187.94	4 869 069.36	7 852 554.39
Nettoinventarwert pro Aktie	88.48	91.44	107.08
Im Umlauf befindliche Aktien	45 888.20	53 248.79	73 333.53
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P USD acc hedged- LU1111708514			
Nettovermögen	14 235 167.20	14 249 389.87	18 473 967.04
Nettoinventarwert pro Aktie	152.17	148.55	168.53
Im Umlauf befindliche Aktien	93 547.79	95 923.19	109 618.27
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P USD dist hedged- LU1244595242			
Nettovermögen	15 069 474.36	17 748 891.44	24 154 600.47
Nettoinventarwert pro Aktie	105.40	105.99	122.79
Im Umlauf befindliche Aktien	142 974.14	167 458.17	196 714.72
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C CHF acc- LU2076229074			
Nettovermögen	6 602 333.96	6 500 660.32	6 486 082.14
Nettoinventarwert pro Aktie	104.29	99.20	132.72
Im Umlauf befindliche Aktien	63 307.45	65 530.85	48 870.42
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C EUR acc- LU0950589498			
Nettovermögen	37 579 051.62	41 146 227.18	44 501 401.40
Nettoinventarwert pro Aktie	288.99	268.05	327.46
Im Umlauf befindliche Aktien	130 035.82	153 502.06	135 898.74
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C EUR dist- LU1732171373			
Nettovermögen	8 934 947.19	13 196 756.33	16 746 336.47
Nettoinventarwert pro Aktie	158.10	146.65	179.15
Im Umlauf befindliche Aktien	56 514.53	89 988.11	93 476.62
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C GBP acc- LU2076229405			
Nettovermögen	676 784.41	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	101.54	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	6 665.20	-	-

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C USD acc- LU1111703127			
Nettovermögen	11 814 297.28	14 105 993.31	19 470 709.18
Nettoinventarwert pro Aktie	125.96	111.95	155.14
Im Umlauf befindliche Aktien	93 794.04	126 002.62	125 504.12
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I EUR acc- LU0405184523			
Nettovermögen	78 831 838.32	75 381 279.41	86 188 228.59
Nettoinventarwert pro Aktie	301.88	279.62	341.12
Im Umlauf befindliche Aktien	261 136.34	269 584.72	252 662.49
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD (BRL hedged) acc- LU2067136072			
Nettovermögen	86 729 555.78	206 959 685.84	442 865 300.19
Nettoinventarwert pro Aktie	178.77	134.97	183.85
Im Umlauf befindliche Aktien	485 146.03	1 533 375.46	2 408 840.36
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD acc- LU1111703390			
Nettovermögen	37 421 287.46	46 413 446.65	48 473 503.19
Nettoinventarwert pro Aktie	126.62	112.40	155.53
Im Umlauf befindliche Aktien	295 540.10	412 931.02	311 666.58
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD dist- LU1991390706			
Nettovermögen	147 553.30	180 389.16	98 823.09
Nettoinventarwert pro Aktie	126.59	112.35	155.48
Im Umlauf befindliche Aktien	1 165.60	1 605.60	635.60
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 CHF acc- LU2008796604			
Nettovermögen	256 725.00	23 246 309.71	46 998 048.08
Nettoinventarwert pro Aktie	122.25	115.55	153.62
Im Umlauf befindliche Aktien	2 100.00	201 179.66	305 937.04
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 EUR acc- LU2008796273			
Nettovermögen	39 253 679.07	36 177 784.34	47 535 604.93
Nettoinventarwert pro Aktie	125.32	115.50	140.20
Im Umlauf befindliche Aktien	313 227.57	313 227.57	339 055.67
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 USD acc- LU2008796430			
Nettovermögen	1 667 026.72	3 934 467.85	4 491 776.45
Nettoinventarwert pro Aktie	92.80	81.95	112.85
Im Umlauf befindliche Aktien	17 963.65	48 010.59	39 803.07
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I30 CHF acc- LU2427699371			
Nettovermögen	5 529 263.82	23 611 442.12	-
Nettoinventarwert pro Aktie	98.70	93.24	-
Im Umlauf befindliche Aktien	56 020.91	253 232.97	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -IH1 NOK acc- LU2076230247			
Nettovermögen	184 783 298.05	143 574 982.38	616 044 874.21
Nettoinventarwert pro Aktie	1 079.90	984.44	1 332.55
Im Umlauf befindliche Aktien	171 111.49	145 844.32	462 305.26
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -M CHF acc- LU2499280977			
Nettovermögen	7 272 296.56	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	99.65	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	72 978.39	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -M EUR acc- LU0950589571			
Nettovermögen	17 025 299.20	13 174 107.50	15 432 697.40
Nettoinventarwert pro Aktie	99.20	90.95	109.81
Im Umlauf befindliche Aktien	171 626.00	144 850.00	140 540.00

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P EUR acc- LU0480508919			
Nettovermögen	151 450 740.05	155 559 343.40	199 506 502.10
Nettoinventarwert pro Aktie	274.97	256.33	314.71
Im Umlauf befindliche Aktien	550 790.05	606 871.39	633 937.60
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P EUR dist- LU0229773345			
Nettovermögen	323 866 107.08	314 026 993.39	375 300 886.50
Nettoinventarwert pro Aktie	274.68	256.06	314.38
Im Umlauf befindliche Aktien	1 179 066.94	1 226 380.51	1 193 781.05
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P SGD acc- LU2361429579			
Nettovermögen	1 344 190.00	1 452 600.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	79.07	72.63	-
Im Umlauf befindliche Aktien	17 000.00	20 000.00	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P USD acc- LU1111703473			
Nettovermögen	97 689 186.62	115 217 183.25	147 350 049.47
Nettoinventarwert pro Aktie	129.81	115.95	161.48
Im Umlauf befindliche Aktien	752 555.17	993 679.89	912 497.21
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P USD dist- LU1732171290			
Nettovermögen	5 265 302.87	15 492 629.94	18 126 733.21
Nettoinventarwert pro Aktie	123.57	110.38	153.73
Im Umlauf befindliche Aktien	42 609.88	140 357.22	117 912.79
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -S EUR dist- LU2076230833			
Nettovermögen	1 780 219.60	1 376 465.22	1 929 846.34
Nettoinventarwert pro Aktie	128.68	118.76	144.36
Im Umlauf befindliche Aktien	13 834.47	11 590.31	13 368.29
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -Y EUR acc- LU1205684001			
Nettovermögen	8 766 561.99	635 334.67	6 312 989.73
Nettoinventarwert pro Aktie	175.08	161.37	195.85
Im Umlauf befindliche Aktien	50 071.75	3 937.13	32 233.80
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -Y USD dist- LU2161043588			
Nettovermögen	60 862 449.78	54 982 275.91	59 497 519.86
Nettoinventarwert pro Aktie	92.86	81.99	112.90
Im Umlauf befindliche Aktien	655 421.60	670 597.34	526 993.09
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C CHF acc hedged- LU1073945245			
Nettovermögen	406 936.40	409 143.36	101 385.53
Nettoinventarwert pro Aktie	90.35	90.84	99.50
Im Umlauf befindliche Aktien	4 504.00	4 504.00	1 018.95
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C EUR acc hedged- LU1073945328			
Nettovermögen	5 215 904.53	4 420 221.91	1 596 731.86
Nettoinventarwert pro Aktie	94.78	94.37	103.22
Im Umlauf befindliche Aktien	55 031.70	46 839.27	15 469.21
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C EUR dist hedged- LU1244596133			
Nettovermögen	156 446.65	5 200 546.62	5 969 009.72
Nettoinventarwert pro Aktie	89.01	90.70	100.46
Im Umlauf befindliche Aktien	1 757.63	57 337.89	59 416.78
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C USD acc- LU1073945161			
Nettovermögen	10 133 539.89	14 007 597.68	16 689 557.01
Nettoinventarwert pro Aktie	113.52	109.87	118.82
Im Umlauf befindliche Aktien	89 266.56	127 492.47	140 460.84

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C USD dist- LU1210452063			
Nettovermögen	130 531 946.81	152 566 731.57	180 148 750.93
Nettoinventarwert pro Aktie	92.35	91.72	101.56
Im Umlauf befindliche Aktien	1 413 448.26	1 663 396.55	1 773 815.98
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -I USD acc- LU1073945591			
Nettovermögen	3 331 349.07	3 269 469.83	13 524 594.54
Nettoinventarwert pro Aktie	115.34	111.48	120.39
Im Umlauf befindliche Aktien	28 882.86	29 327.86	112 339.85
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P CHF acc hedged- LU1073944941			
Nettovermögen	4 869 108.30	6 977 831.36	9 739 648.90
Nettoinventarwert pro Aktie	78.45	79.01	86.63
Im Umlauf befindliche Aktien	62 066.39	88 315.80	112 428.13
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P EUR acc hedged- LU1073945088			
Nettovermögen	40 757 053.09	16 285 499.58	29 990 255.30
Nettoinventarwert pro Aktie	73.91	73.69	80.73
Im Umlauf befindliche Aktien	551 441.66	221 000.13	371 488.36
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P USD acc- LU1073944867			
Nettovermögen	48 117 327.13	61 011 057.45	88 393 607.95
Nettoinventarwert pro Aktie	112.42	108.91	117.90
Im Umlauf befindliche Aktien	428 013.94	560 197.02	749 733.74
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P USD dist- LU1210451842			
Nettovermögen	9 543 890.72	11 847 167.18	16 659 843.71
Nettoinventarwert pro Aktie	92.80	92.18	102.06
Im Umlauf befindliche Aktien	102 843.65	128 522.10	163 235.78
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y CHF acc hedged- LU1201473581			
Nettovermögen	92 349.45	185 048.40	193 881.16
Nettoinventarwert pro Aktie	90.45	90.71	99.02
Im Umlauf befindliche Aktien	1 021.00	2 040.00	1 958.00
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y EUR acc hedged- LU1201473664			
Nettovermögen	1 998 370.75	2 640 883.41	3 951 986.29
Nettoinventarwert pro Aktie	91.30	90.64	98.78
Im Umlauf befindliche Aktien	21 887.96	29 135.96	40 007.96
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y USD dist- LU1210452659			
Nettovermögen	1 028 096.55	1 480 202.41	7 503 775.63
Nettoinventarwert pro Aktie	93.15	92.53	102.47
Im Umlauf befindliche Aktien	11 037.00	15 997.00	73 229.00
JSS Sustainable Bond CHF -C CHF acc- LU0950591809			
Nettovermögen	3 152 398.28	2 171 724.38	1 331 726.14
Nettoinventarwert pro Aktie	146.25	145.94	158.05
Im Umlauf befindliche Aktien	21 554.86	14 880.94	8 425.98
JSS Sustainable Bond CHF -M CHF acc- LU0950591981			
Nettovermögen	2 024 938.24	1 267 904.88	912 831.09
Nettoinventarwert pro Aktie	93.44	92.88	100.19
Im Umlauf befindliche Aktien	21 671.00	13 651.00	9 111.00
JSS Sustainable Bond CHF -P CHF dist- LU0121751324			
Nettovermögen	15 539 561.03	16 860 241.49	19 025 502.84
Nettoinventarwert pro Aktie	140.83	140.89	152.96
Im Umlauf befindliche Aktien	110 342.69	119 669.54	124 382.21

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C CHF acc hedged- LU2076224786			
Nettovermögen	944 851.78	432 101.80	489 372.40
Nettoinventarwert pro Aktie	82.35	87.47	101.11
Im Umlauf befindliche Aktien	11 473.61	4 940.00	4 840.00
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C EUR acc- LU0950592104			
Nettovermögen	3 495 549.41	2 762 118.29	3 699 848.22
Nettoinventarwert pro Aktie	109.62	114.92	132.35
Im Umlauf befindliche Aktien	31 887.88	24 035.14	27 955.03
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C EUR dist- LU1732171969			
Nettovermögen	3 661 337.73	2 344 792.31	2 429 536.92
Nettoinventarwert pro Aktie	84.59	88.68	102.12
Im Umlauf befindliche Aktien	43 283.34	26 441.05	23 791.00
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -I EUR acc- LU2076225163			
Nettovermögen	20 795 317.10	19 384 192.41	9 983 203.42
Nettoinventarwert pro Aktie	87.13	91.10	104.66
Im Umlauf befindliche Aktien	238 670.00	212 779.28	95 387.00
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -I EUR dist- LU2076225247			
Nettovermögen	-	-	3 169 233.00
Nettoinventarwert pro Aktie	-	-	98.73
Im Umlauf befindliche Aktien	-	-	32 100.00
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P CHF dist hedged- LU2076224273			
Nettovermögen	18 823 971.48	20 182 667.01	22 871 722.14
Nettoinventarwert pro Aktie	80.58	85.83	99.46
Im Umlauf befindliche Aktien	233 606.00	235 147.00	229 959.00
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P EUR acc- LU2076223622			
Nettovermögen	9 094 426.46	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	113.94	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	79 817.68	-	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P EUR dist- LU0158938935			
Nettovermögen	48 311 487.70	58 865 225.30	75 305 691.79
Nettoinventarwert pro Aktie	104.06	109.37	126.27
Im Umlauf befindliche Aktien	464 265.69	538 220.95	596 386.25
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y CHF acc hedged- LU2076226054			
Nettovermögen	186 142.00	12 413 559.63	15 911 127.91
Nettoinventarwert pro Aktie	84.61	89.86	103.81
Im Umlauf befindliche Aktien	2 200.00	138 143.33	153 271.63
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y EUR acc- LU1752454568			
Nettovermögen	9 808 052.40	7 699 267.42	6 288 339.29
Nettoinventarwert pro Aktie	92.95	97.35	111.99
Im Umlauf befindliche Aktien	105 519.66	79 088.52	56 150.90
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y EUR dist- LU1752454485			
Nettovermögen	2 474 700.00	2 661 120.00	2 067 936.00
Nettoinventarwert pro Aktie	82.49	86.40	99.42
Im Umlauf befindliche Aktien	30 000.00	30 800.00	20 800.00
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -C EUR acc- LU0950591718			
Nettovermögen	4 996 408.32	3 664 968.51	9 328 590.49
Nettoinventarwert pro Aktie	96.77	97.74	113.48
Im Umlauf befindliche Aktien	51 631.79	37 497.12	82 204.71

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -C EUR dist- LU1732172009			
Nettovermögen	640 385.58	505 702.00	473 297.00
Nettoinventarwert pro Aktie	86.33	87.19	101.24
Im Umlauf befindliche Aktien	7 417.88	5 800.00	4 675.00
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -I EUR acc- LU0734492860			
Nettovermögen	4 767 280.80	6 555 255.98	19 448 937.69
Nettoinventarwert pro Aktie	170.40	171.86	199.26
Im Umlauf befindliche Aktien	27 977.00	38 143.00	97 605.83
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -M EUR acc- LU0776582891			
Nettovermögen	3 549 867.20	5 410 762.50	8 858 228.10
Nettoinventarwert pro Aktie	177.76	178.75	206.63
Im Umlauf befindliche Aktien	19 970.00	30 270.00	42 870.00
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -P EUR dist- LU0045164786			
Nettovermögen	29 477 289.70	30 806 612.11	38 818 806.62
Nettoinventarwert pro Aktie	143.14	144.93	169.80
Im Umlauf befindliche Aktien	205 933.28	212 562.01	228 614.88
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -Y CHF dist hedged- LU2312587103			
Nettovermögen	14 767 005.76	16 456 811.98	19 252 881.92
Nettoinventarwert pro Aktie	83.77	85.71	99.76
Im Umlauf befindliche Aktien	176 280.36	192 005.74	192 992.00
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -Y EUR acc- LU1205683706			
Nettovermögen	28 402 416.03	29 956 638.77	33 492 805.16
Nettoinventarwert pro Aktie	93.40	94.19	109.20
Im Umlauf befindliche Aktien	304 094.39	318 044.79	306 710.67
JSS Sustainable Equity - Europe -C EUR acc- LU0950592369			
Nettovermögen	735 765.67	637 162.68	1 754 721.26
Nettoinventarwert pro Aktie	122.56	106.49	119.38
Im Umlauf befindliche Aktien	6 003.31	5 983.31	14 698.62
JSS Sustainable Equity - Europe -P EUR acc- LU0484532444			
Nettovermögen	11 310 237.44	10 047 685.70	11 803 675.26
Nettoinventarwert pro Aktie	121.10	105.59	118.79
Im Umlauf befindliche Aktien	93 395.85	95 157.55	99 365.90
JSS Sustainable Equity - Europe -P EUR dist- LU0058891119			
Nettovermögen	21 063 657.74	19 866 715.55	23 490 573.18
Nettoinventarwert pro Aktie	112.84	99.89	112.37
Im Umlauf befindliche Aktien	186 668.36	198 885.93	209 046.66
JSS Sustainable Equity - Europe -P USD acc- LU1096900078			
Nettovermögen	2 508 661.32	2 483 352.94	3 377 553.32
Nettoinventarwert pro Aktie	125.57	104.91	133.89
Im Umlauf befindliche Aktien	19 978.19	23 671.27	25 226.33
JSS Sustainable Equity - Europe -Y EUR acc- LU1205683888			
Nettovermögen	2 315 855.97	3 022 775.76	5 221 666.92
Nettoinventarwert pro Aktie	124.77	107.76	120.09
Im Umlauf befindliche Aktien	18 561.00	28 051.00	43 481.28
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C CHF acc- LU2273127774			
Nettovermögen	432 109.04	384 486.87	148 428.49
Nettoinventarwert pro Aktie	92.46	83.46	101.77
Im Umlauf befindliche Aktien	4 673.47	4 606.84	1 458.47

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C EUR acc- LU0950592443			
Nettovermögen	1 753 613.84	2 123 919.64	1 470 296.14
Nettoinventarwert pro Aktie	232.76	204.90	228.14
Im Umlauf befindliche Aktien	7 534.00	10 365.64	6 444.71
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C USD acc- LU1111704364			
Nettovermögen	2 702 502.39	3 097 151.02	1 075 707.22
Nettoinventarwert pro Aktie	100.02	84.38	106.56
Im Umlauf befindliche Aktien	27 019.62	36 704.80	10 094.85
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -I CHF acc- LU2273128319			
Nettovermögen	-	8 580 000.00	10 438 000.00
Nettoinventarwert pro Aktie	-	85.80	104.38
Im Umlauf befindliche Aktien	-	100 000.00	100 000.00
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -I EUR acc- LU1111704521			
Nettovermögen	5 076 960.00	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	105.77	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	48 000.00	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -M CHF acc- LU2499280894			
Nettovermögen	5 324 217.93	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	103.07	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	51 656.33	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -M EUR acc- LU0749004452			
Nettovermögen	353 029.61	596 242.60	1 063 175.01
Nettoinventarwert pro Aktie	254.93	222.08	244.70
Im Umlauf befindliche Aktien	1 384.81	2 684.81	4 344.81
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -P EUR dist- LU0097427784			
Nettovermögen	63 920 231.29	58 991 654.58	67 235 504.43
Nettoinventarwert pro Aktie	219.69	194.37	217.72
Im Umlauf befindliche Aktien	290 956.49	303 501.85	308 816.39
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -P USD acc- LU1111704448			
Nettovermögen	9 239 321.41	8 676 821.42	10 163 284.91
Nettoinventarwert pro Aktie	159.95	135.61	172.31
Im Umlauf befindliche Aktien	57 763.81	63 983.64	58 982.56
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -C EUR acc- LU0950592872			
Nettovermögen	2 190 240.76	2 489 115.99	1 464 816.85
Nettoinventarwert pro Aktie	141.97	166.84	176.13
Im Umlauf befindliche Aktien	15 427.49	14 919.18	8 316.68
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -C EUR dist- LU1991392827			
Nettovermögen	57 618.24	67 710.08	12 491.18
Nettoinventarwert pro Aktie	76.62	90.04	100.21
Im Umlauf befindliche Aktien	752.00	752.00	124.65
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -I EUR acc- LU0950592955			
Nettovermögen	13 026 733.93	9 169 543.75	12 958 571.77
Nettoinventarwert pro Aktie	82.10	96.35	101.58
Im Umlauf befindliche Aktien	158 669.11	95 169.11	127 570.11
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P EUR acc- LU0288928376			
Nettovermögen	13 497 169.66	16 112 652.61	16 119 169.54
Nettoinventarwert pro Aktie	135.14	159.60	169.33
Im Umlauf befindliche Aktien	99 875.46	100 956.47	95 193.82

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P EUR dist- LU1991392074			
Nettovermögen	1 281 009.12	1 730 605.40	2 094 470.08
Nettoinventarwert pro Aktie	80.09	94.59	100.35
Im Umlauf befindliche Aktien	15 994.62	18 295.86	20 871.65
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P USD acc- LU1111705098			
Nettovermögen	298 889.69	344 945.97	415 151.70
Nettoinventarwert pro Aktie	77.67	87.90	105.79
Im Umlauf befindliche Aktien	3 848.20	3 924.30	3 924.30
JSS Sustainable Equity - USA -C USD acc- LU0950593094			
Nettovermögen	7 131 409.63	19 671 050.72	25 362 753.06
Nettoinventarwert pro Aktie	348.32	296.42	342.59
Im Umlauf befindliche Aktien	20 473.73	66 362.09	74 032.38
JSS Sustainable Equity - USA -I USD acc- LU1111705254			
Nettovermögen	-	6 730 755.00	8 692 441.35
Nettoinventarwert pro Aktie	-	154.73	178.38
Im Umlauf befindliche Aktien	-	43 500.00	48 729.91
JSS Sustainable Equity - USA -I USD dist- LU2076232961			
Nettovermögen	2 659 595.89	1 501 544.35	1 980 974.12
Nettoinventarwert pro Aktie	182.43	154.74	178.38
Im Umlauf befindliche Aktien	14 578.72	9 703.66	11 105.36
JSS Sustainable Equity - USA -I10 USD acc- LU2427700138			
Nettovermögen	34 245 334.88	32 247 671.96	-
Nettoinventarwert pro Aktie	100.06	84.79	-
Im Umlauf befindliche Aktien	342 248.00	380 324.00	-
JSS Sustainable Equity - USA -P USD acc- LU0526864581			
Nettovermögen	43 731 238.06	44 062 371.59	44 789 684.42
Nettoinventarwert pro Aktie	336.91	287.88	334.19
Im Umlauf befindliche Aktien	129 800.95	153 058.12	134 024.61
JSS Sustainable Equity - USA -P USD dist- LU2076232706			
Nettovermögen	4 198 048.30	5 803 852.37	11 002 114.75
Nettoinventarwert pro Aktie	178.28	152.34	176.84
Im Umlauf befindliche Aktien	23 547.50	38 098.02	62 215.08
JSS Sustainable Equity - USA -Y USD acc- LU1629314664			
Nettovermögen	89 059 560.07	62 056 757.37	55 201 570.87
Nettoinventarwert pro Aktie	166.41	140.78	161.74
Im Umlauf befindliche Aktien	535 181.54	440 806.63	341 298.20
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C EUR acc- LU0950593177			
Nettovermögen	5 557 872.43	4 760 344.25	-
Nettoinventarwert pro Aktie	123.74	126.30	-
Im Umlauf befindliche Aktien	44 915.73	37 690.77	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I EUR acc- LU1842720168			
Nettovermögen	16 031 565.35	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	100.11	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	160 139.50	-	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I EUR dist- LU1842720242			
Nettovermögen	590 625.00	600 705.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	93.75	95.35	-
Im Umlauf befindliche Aktien	6 300.00	6 300.00	-

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I H2 CHF dist- LU2273130562			
Nettovermögen	904 990.30	1 919 138.55	1 073 638.00
Nettoinventarwert pro Aktie	85.49	90.16	100.34
Im Umlauf befindliche Aktien	10 585.92	21 285.92	10 700.00
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I USD H2 acc- LU1842720325			
Nettovermögen	904 266.00	892 287.00	4 033 179.05
Nettoinventarwert pro Aktie	91.34	90.13	101.58
Im Umlauf befindliche Aktien	9 900.00	9 900.00	39 704.46
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P CHF H2 acc- LU1111702079			
Nettovermögen	1 519 017.85	1 786 704.63	1 403 786.69
Nettoinventarwert pro Aktie	206.30	215.64	241.94
Im Umlauf befindliche Aktien	7 363.15	8 285.59	5 802.21
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P EUR acc- LU1111705338			
Nettovermögen	737 787.96	818 957.17	-
Nettoinventarwert pro Aktie	86.77	88.99	-
Im Umlauf befindliche Aktien	8 502.80	9 202.80	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P EUR dist- LU0058892943			
Nettovermögen	170 073 743.44	184 871 748.82	195 379 240.07
Nettoinventarwert pro Aktie	213.34	220.76	235.84
Im Umlauf befindliche Aktien	797 195.76	837 433.18	828 439.79
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P USD H2 acc- LU1842719665			
Nettovermögen	340 554.68	338 795.08	-
Nettoinventarwert pro Aktie	92.90	92.42	-
Im Umlauf befindliche Aktien	3 665.82	3 665.82	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C CHF H1 acc- LU1111702236			
Nettovermögen	6 167 458.39	5 832 463.75	5 071 137.25
Nettoinventarwert pro Aktie	156.71	134.63	161.83
Im Umlauf befindliche Aktien	39 355.87	43 322.17	31 336.20
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C EUR acc- LU0950593250			
Nettovermögen	23 712 542.37	23 624 828.52	19 992 613.19
Nettoinventarwert pro Aktie	301.66	258.36	286.84
Im Umlauf befindliche Aktien	78 606.85	91 441.51	69 699.53
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C EUR dist- LU1732172694			
Nettovermögen	3 159 329.37	2 789 661.05	2 462 244.89
Nettoinventarwert pro Aktie	132.90	113.82	126.37
Im Umlauf befindliche Aktien	23 772.23	24 509.41	19 484.41
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C USD acc- LU1111705684			
Nettovermögen	2 653 266.42	3 101 270.50	3 225 037.46
Nettoinventarwert pro Aktie	99.77	81.88	103.11
Im Umlauf befindliche Aktien	26 593.83	37 875.80	31 277.64
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C USD dist- LU1732172777			
Nettovermögen	1 412 462.44	1 655 188.00	2 064 000.00
Nettoinventarwert pro Aktie	99.84	81.94	103.20
Im Umlauf befindliche Aktien	14 147.26	20 200.00	20 000.00
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I CHF acc- LU1965939850			
Nettovermögen	1 633 964.70	2 712 600.41	3 282 675.00
Nettoinventarwert pro Aktie	114.56	100.02	121.04
Im Umlauf befindliche Aktien	14 262.96	27 120.58	27 120.58

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I EUR acc- LU0333595519			
Nettovermögen	12 754 794.40	5 313 032.96	5 355 315.18
Nettoinventarwert pro Aktie	307.34	261.68	289.14
Im Umlauf befindliche Aktien	41 500.60	20 303.55	18 521.53
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I EUR dist- LU1732172850			
Nettovermögen	1 404 165.29	1 069 955.60	2 292 375.40
Nettoinventarwert pro Aktie	137.04	116.68	128.93
Im Umlauf befindliche Aktien	10 246.39	9 170.00	17 780.00
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I10 EUR acc- LU2427703074			
Nettovermögen	33 186 009.78	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	105.66	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	314 083.00	-	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P CHF H1 acc - LU1111702319			
Nettovermögen	11 810 865.77	10 020 107.68	9 559 306.61
Nettoinventarwert pro Aktie	151.50	130.65	157.92
Im Umlauf befindliche Aktien	77 959.51	76 694.28	60 532.59
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P EUR acc- LU0707700596			
Nettovermögen	35 820 077.13	35 663 124.35	36 580 926.33
Nettoinventarwert pro Aktie	275.13	236.58	264.15
Im Umlauf befindliche Aktien	130 193.28	150 744.46	138 485.43
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P EUR dist- LU0333595436			
Nettovermögen	139 937 199.12	123 338 485.32	138 698 548.40
Nettoinventarwert pro Aktie	275.12	236.57	264.14
Im Umlauf befindliche Aktien	508 640.59	521 361.48	525 094.83
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P GBP dist- LU1545800341			
Nettovermögen	791 670.68	1 148 334.81	512 228.60
Nettoinventarwert pro Aktie	107.96	93.13	103.69
Im Umlauf befindliche Aktien	7 333.00	12 330.45	4 940.00
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P USD H1 acc- LU1120832198			
Nettovermögen	16 041 836.75	18 671 428.20	18 525 604.48
Nettoinventarwert pro Aktie	188.62	155.07	184.31
Im Umlauf befindliche Aktien	85 048.44	120 406.45	100 513.29
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P USD dist- LU0950593417			
Nettovermögen	20 877 001.25	18 716 186.07	23 749 215.49
Nettoinventarwert pro Aktie	298.84	246.23	311.87
Im Umlauf befindliche Aktien	69 860.13	76 010.99	76 151.01
JSS Sustainable Equity - Green Planet -S EUR dist- LU1842716729			
Nettovermögen	2 847 613.90	2 511 739.92	2 769 674.37
Nettoinventarwert pro Aktie	151.54	129.33	143.09
Im Umlauf befindliche Aktien	18 791.17	19 421.17	19 356.17
JSS Sustainable Equity - Green Planet -Y EUR acc- LU1205684183			
Nettovermögen	45 080 731.49	36 103 983.78	40 510 389.47
Nettoinventarwert pro Aktie	202.42	172.07	189.70
Im Umlauf befindliche Aktien	222 708.88	209 821.49	213 549.76
JSS Bond - USD High Yield -C EUR acc hedged- LU1184841341			
Nettovermögen	2 576 987.77	2 511 983.10	3 566 837.20
Nettoinventarwert pro Aktie	112.31	108.36	127.39
Im Umlauf befindliche Aktien	22 945.31	23 181.83	27 999.35

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Bond - USD High Yield -C USD acc- LU1184840962			
Nettovermögen	7 510 974.83	7 446 916.19	6 681 477.40
Nettoinventarwert pro Aktie	130.10	121.77	141.12
Im Umlauf befindliche Aktien	57 732.32	61 155.59	47 346.07
JSS Bond - USD High Yield -C USD dist- LU1210450109			
Nettovermögen	9 131 830.92	8 329 069.64	13 206 041.47
Nettoinventarwert pro Aktie	94.29	92.55	111.22
Im Umlauf befindliche Aktien	96 848.35	89 995.35	118 738.01
JSS Bond - USD High Yield -I CHF acc hedged- LU1184841937			
Nettovermögen	-	31 310.93	33 482.40
Nettoinventarwert pro Aktie	-	101.99	119.58
Im Umlauf befindliche Aktien	-	307.00	280.00
JSS Bond - USD High Yield -I USD acc- LU1184841770			
Nettovermögen	13 120 039.31	12 510 893.72	15 324 147.03
Nettoinventarwert pro Aktie	132.77	123.97	143.32
Im Umlauf befindliche Aktien	98 817.80	100 918.72	106 922.60
JSS Bond - USD High Yield -I USD dist- LU1210450018			
Nettovermögen	843 411.74	6 022 295.46	7 382 749.82
Nettoinventarwert pro Aktie	94.41	92.69	111.40
Im Umlauf befindliche Aktien	8 933.50	64 972.44	66 272.44
JSS Bond - USD High Yield -P CHF acc hedged- LU1184840293			
Nettovermögen	866 199.31	1 434 288.04	1 727 481.15
Nettoinventarwert pro Aktie	105.69	103.29	121.89
Im Umlauf befindliche Aktien	8 195.66	13 886.03	14 172.46
JSS Bond - USD High Yield -P CHF dist hedged- LU1184840459			
Nettovermögen	658 614.16	521 028.22	458 205.98
Nettoinventarwert pro Aktie	79.14	81.13	98.94
Im Umlauf befindliche Aktien	8 322.14	6 422.14	4 631.15
JSS Bond - USD High Yield -P EUR acc hedged- LU1184840533			
Nettovermögen	4 435 787.55	6 263 660.91	8 530 844.03
Nettoinventarwert pro Aktie	110.05	106.42	125.21
Im Umlauf befindliche Aktien	40 307.02	58 857.93	68 132.29
JSS Bond - USD High Yield -P EUR dist hedged- LU1184840707			
Nettovermögen	2 472 941.25	2 475 807.33	3 107 987.95
Nettoinventarwert pro Aktie	81.25	82.38	100.42
Im Umlauf befindliche Aktien	30 436.20	30 053.50	30 949.89
JSS Bond - USD High Yield -P USD acc- LU1184840020			
Nettovermögen	84 364 820.97	100 186 756.41	140 308 648.74
Nettoinventarwert pro Aktie	126.96	119.19	138.54
Im Umlauf befindliche Aktien	664 499.22	840 563.44	1 012 766.34
JSS Bond - USD High Yield -P USD dist- LU1210449945			
Nettovermögen	60 445 051.74	65 311 068.93	76 029 388.60
Nettoinventarwert pro Aktie	90.23	92.42	111.05
Im Umlauf befindliche Aktien	669 899.72	706 676.79	684 641.05
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C CHF acc hedged- LU1332517405			
Nettovermögen	3 555 104.20	3 750 624.28	5 427 767.98
Nettoinventarwert pro Aktie	85.39	86.34	100.11
Im Umlauf befindliche Aktien	41 633.73	43 440.17	54 218.04

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C EUR acc hedged- LU1332517660			
Nettovermögen	10 639 579.77	9 225 457.32	11 497 496.98
Nettoinventarwert pro Aktie	89.18	89.12	103.21
Im Umlauf befindliche Aktien	119 304.55	103 517.25	111 399.06
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C USD acc- LU1332517231			
Nettovermögen	18 387 052.85	16 504 770.46	23 281 891.75
Nettoinventarwert pro Aktie	104.37	101.24	115.69
Im Umlauf befindliche Aktien	176 171.82	163 026.18	201 243.77
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C USD dist- LU1332517314			
Nettovermögen	1 580 747.94	1 589 095.46	2 952 784.40
Nettoinventarwert pro Aktie	89.98	92.08	106.83
Im Umlauf befindliche Aktien	17 567.77	17 257.77	27 640.03
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I CHF acc hedged- LU1332518122			
Nettovermögen	24 825 311.19	26 213 775.16	37 143 441.31
Nettoinventarwert pro Aktie	93.26	94.06	108.86
Im Umlauf befindliche Aktien	266 194.63	278 692.06	341 203.76
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I EUR acc hedged- LU1332518478			
Nettovermögen	9 619 047.89	6 615 115.18	48 608 739.13
Nettoinventarwert pro Aktie	93.07	92.86	107.35
Im Umlauf befindliche Aktien	103 352.83	71 237.51	452 806.14
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I EUR dist hedged- LU1332518551			
Nettovermögen	2 377 930.00	2 300 987.99	4 574 553.27
Nettoinventarwert pro Aktie	80.20	84.49	99.31
Im Umlauf befindliche Aktien	29 650.00	27 233.85	46 063.37
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I USD acc- LU1332517827			
Nettovermögen	16 388 528.09	15 478 048.47	64 813 151.57
Nettoinventarwert pro Aktie	113.72	110.10	125.58
Im Umlauf befindliche Aktien	144 112.98	140 581.73	516 110.46
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I USD dist- LU1332518049			
Nettovermögen	15 517 126.55	15 819 075.91	19 514 918.41
Nettoinventarwert pro Aktie	90.96	92.73	107.58
Im Umlauf befindliche Aktien	170 592.86	170 592.86	181 399.13
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -M CHF acc hedged- LU1332518635			
Nettovermögen	30 668 366.70	37 839 819.31	49 017 432.41
Nettoinventarwert pro Aktie	96.54	97.00	111.87
Im Umlauf befindliche Aktien	317 675.23	390 101.23	438 164.23
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P CHF acc hedged- LU1332516852			
Nettovermögen	13 795 639.77	12 696 088.30	26 655 707.66
Nettoinventarwert pro Aktie	90.04	91.18	106.09
Im Umlauf befindliche Aktien	153 216.79	139 242.03	251 255.61
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P EUR acc hedged- LU1332517074			
Nettovermögen	19 028 909.12	16 052 013.49	46 532 159.56
Nettoinventarwert pro Aktie	92.80	93.04	108.10
Im Umlauf befindliche Aktien	205 052.90	172 528.09	430 454.76
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P EUR dist hedged- LU1332517157			
Nettovermögen	4 423 604.63	3 730 320.31	5 017 828.09
Nettoinventarwert pro Aktie	80.55	82.18	96.64
Im Umlauf befindliche Aktien	54 917.50	45 392.07	51 922.89

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P USD acc- LU1332516696			
Nettovermögen	57 096 383.58	78 791 267.17	139 626 459.28
Nettoinventarwert pro Aktie	109.25	106.34	121.94
Im Umlauf befindliche Aktien	522 621.36	740 937.25	1 145 042.31
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P USD dist- LU1332516779			
Nettovermögen	17 158 955.32	17 255 196.29	25 951 463.20
Nettoinventarwert pro Aktie	99.41	98.22	113.94
Im Umlauf befindliche Aktien	172 607.94	175 679.05	227 764.29
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y CHF acc hedged- LU1405747244			
Nettovermögen	27 761 023.14	20 714 199.66	36 710 548.21
Nettoinventarwert pro Aktie	88.45	89.10	103.03
Im Umlauf befindliche Aktien	313 861.20	232 482.60	356 309.31
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y EUR acc hedged- LU1405747327			
Nettovermögen	51 530 245.89	36 066 882.05	53 684 532.30
Nettoinventarwert pro Aktie	91.30	90.92	104.88
Im Umlauf befindliche Aktien	564 405.76	396 688.10	511 866.25
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y GBP dist hedged- LU1405749539			
Nettovermögen	6 267 324.42	4 857 638.18	5 666 140.01
Nettoinventarwert pro Aktie	84.93	86.54	99.80
Im Umlauf befindliche Aktien	73 794.00	56 131.71	56 774.95
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y USD acc- LU1405747087			
Nettovermögen	16 877 619.72	16 322 190.55	22 396 862.72
Nettoinventarwert pro Aktie	104.53	101.09	115.18
Im Umlauf befindliche Aktien	161 461.97	161 461.97	194 450.97
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y USD dist- LU1405747160			
Nettovermögen	60 956 804.28	52 775 696.71	66 039 374.68
Nettoinventarwert pro Aktie	92.33	92.39	107.13
Im Umlauf befindliche Aktien	660 205.83	571 227.37	616 441.47
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C EUR acc- LU1752455532			
Nettovermögen	2 288 119.51	2 474 888.44	3 304 331.14
Nettoinventarwert pro Aktie	133.31	111.13	137.63
Im Umlauf befindliche Aktien	17 163.90	22 270.21	24 008.80
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C EUR dist- LU1752455615			
Nettovermögen	823 395.60	686 370.30	-
Nettoinventarwert pro Aktie	119.16	99.33	-
Im Umlauf befindliche Aktien	6 910.00	6 910.00	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C USD acc- LU1752455375			
Nettovermögen	1 629 861.42	1 532 898.08	2 796 244.84
Nettoinventarwert pro Aktie	124.61	99.54	139.84
Im Umlauf befindliche Aktien	13 079.70	15 399.82	19 996.03
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -E EUR acc- LU2161045799			
Nettovermögen	511 618.77	427 326.47	-
Nettoinventarwert pro Aktie	112.53	93.99	-
Im Umlauf befindliche Aktien	4 546.51	4 546.51	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -E EUR dist- LU2161045872			
Nettovermögen	536 554.70	317 856.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	118.97	99.33	-
Im Umlauf befindliche Aktien	4 510.00	3 200.00	-

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -I USD acc- LU1752455888			
Nettovermögen	1 036 614.67	-	5 635 600.00
Nettoinventarwert pro Aktie	133.23	-	140.89
Im Umlauf befindliche Aktien	7 780.64	-	40 000.00
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P EUR acc- LU1752454998			
Nettovermögen	1 895 885.98	1 792 082.41	4 167 816.25
Nettoinventarwert pro Aktie	129.33	108.46	135.14
Im Umlauf befindliche Aktien	14 659.29	16 522.98	30 840.73
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P EUR dist- LU1752455292			
Nettovermögen	1 393 807.45	1 607 466.85	3 565 499.76
Nettoinventarwert pro Aktie	129.30	108.44	135.10
Im Umlauf befindliche Aktien	10 779.64	14 823.56	26 391.56
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P USD acc- LU1752454642			
Nettovermögen	4 444 342.14	4 914 166.14	9 327 274.08
Nettoinventarwert pro Aktie	120.85	97.12	137.26
Im Umlauf befindliche Aktien	36 775.69	50 598.91	67 953.33
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P USD dist- LU1752454725			
Nettovermögen	1 570 193.17	1 261 871.42	3 379 801.02
Nettoinventarwert pro Aktie	120.85	97.12	137.26
Im Umlauf befindliche Aktien	12 992.91	12 992.91	24 623.35
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -Y USD acc- LU1752456001			
Nettovermögen	23 974 611.36	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	109.28	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	219 387.00	-	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -Y USD dist- LU1752456266			
Nettovermögen	13 038 055.76	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	93.26	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	139 803.30	-	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C CHF acc- LU1842718345			
Nettovermögen	15 507 542.38	13 515 443.77	17 571 006.95
Nettoinventarwert pro Aktie	152.95	129.99	176.39
Im Umlauf befindliche Aktien	101 389.62	103 972.95	99 614.53
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C EUR acc- LU1752457405			
Nettovermögen	13 196 752.59	10 967 192.24	15 987 035.14
Nettoinventarwert pro Aktie	176.53	146.30	181.27
Im Umlauf befindliche Aktien	74 756.43	74 963.72	88 194.60
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C USD acc- LU1752456936			
Nettovermögen	36 082 396.35	33 724 051.97	53 823 787.59
Nettoinventarwert pro Aktie	164.98	131.03	184.16
Im Umlauf befindliche Aktien	218 707.70	257 376.57	292 266.44
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C USD dist- LU1752457157			
Nettovermögen	5 998 623.17	4 815 220.96	16 248 828.46
Nettoinventarwert pro Aktie	148.82	118.20	166.12
Im Umlauf befindliche Aktien	40 307.91	40 737.91	97 813.80
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -E USD acc- LU1842717453			
Nettovermögen	15 226 532.25	13 396 397.06	22 928 096.84
Nettoinventarwert pro Aktie	164.86	131.32	185.12
Im Umlauf befindliche Aktien	92 360.38	102 013.38	123 855.32

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -E USD dist- LU1842717537			
Nettovermögen	4 787 815.85	4 615 058.74	7 432 306.77
Nettoinventarwert pro Aktie	158.73	126.44	178.24
Im Umlauf befindliche Aktien	30 163.27	36 499.99	41 698.31
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I CHF acc- LU1842718691			
Nettovermögen	2 807 204.40	2 377 800.00	3 219 000.00
Nettoinventarwert pro Aktie	93.48	79.26	107.30
Im Umlauf befindliche Aktien	30 030.00	30 000.00	30 000.00
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I EUR acc- LU2076231567			
Nettovermögen	-	855 748.60	-
Nettoinventarwert pro Aktie	-	70.49	-
Im Umlauf befindliche Aktien	-	12 140.00	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I USD (BRL hedged) acc- LU1842717883			
Nettovermögen	1 538 071.83	1 959 472.42	1 183 687.79
Nettoinventarwert pro Aktie	116.73	79.55	109.88
Im Umlauf befindliche Aktien	13 176.32	24 631.96	10 772.55
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I USD acc- LU1752458551			
Nettovermögen	17 459 665.57	13 079 811.68	87 404 724.45
Nettoinventarwert pro Aktie	167.04	132.35	185.57
Im Umlauf befindliche Aktien	104 523.86	98 827.44	471 006.76
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I10 USD acc- LU2273126701			
Nettovermögen	15 337 137.50	15 743 344.68	-
Nettoinventarwert pro Aktie	83.75	66.29	-
Im Umlauf befindliche Aktien	183 130.00	237 492.00	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -M USD acc- LU1842718006			
Nettovermögen	133 286.85	11 104 438.80	551 768.82
Nettoinventarwert pro Aktie	151.88	129.35	180.14
Im Umlauf befindliche Aktien	877.58	85 848.00	3 063.00
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P CHF dist- LU1842718261			
Nettovermögen	8 629 928.98	7 738 472.33	9 945 313.43
Nettoinventarwert pro Aktie	151.53	129.55	176.87
Im Umlauf befindliche Aktien	56 951.95	59 733.48	56 229.51
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P EUR acc- LU1752456696			
Nettovermögen	12 673 238.68	22 371 819.67	25 121 228.19
Nettoinventarwert pro Aktie	171.22	142.76	177.95
Im Umlauf befindliche Aktien	74 017.28	156 709.30	141 170.15
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P EUR dist- LU1752456852			
Nettovermögen	12 703 349.94	9 791 029.54	12 521 311.87
Nettoinventarwert pro Aktie	171.23	142.77	177.96
Im Umlauf befindliche Aktien	74 188.81	68 579.04	70 360.26
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P USD acc- LU1752456340			
Nettovermögen	75 059 834.11	74 131 790.96	140 249 319.24
Nettoinventarwert pro Aktie	160.02	127.85	180.78
Im Umlauf befindliche Aktien	469 065.33	579 834.11	775 801.08
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P USD dist- LU1752456423			
Nettovermögen	11 579 457.14	11 114 120.54	17 952 818.89
Nettoinventarwert pro Aktie	160.03	127.86	180.78
Im Umlauf befindliche Aktien	72 358.04	86 924.14	99 307.55

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -Y USD acc- LU1752458049			
Nettovermögen	132 528.60	25 542 534.78	444 423.77
Nettoinventarwert pro Aktie	173.24	137.04	191.81
Im Umlauf befindliche Aktien	765.00	186 387.44	2 317.00
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -Y USD dist- LU1752458478			
Nettovermögen	665 701.05	12 493 161.28	1 886 490.90
Nettoinventarwert pro Aktie	150.85	119.31	167.02
Im Umlauf befindliche Aktien	4 413.00	104 711.77	11 295.00
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -C USD acc- LU1835934479			
Nettovermögen	7 430 564.76	8 003 106.95	10 167 997.30
Nettoinventarwert pro Aktie	86.63	80.89	105.21
Im Umlauf befindliche Aktien	85 778.56	98 938.15	96 644.78
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -C USD dist- LU1835934552			
Nettovermögen	1 623 048.70	1 742 427.44	2 592 928.81
Nettoinventarwert pro Aktie	73.55	72.78	99.86
Im Umlauf befindliche Aktien	22 065.58	23 941.02	25 965.64
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -I USD acc- LU1835934636			
Nettovermögen	880 056.00	817 400.00	1 059 300.00
Nettoinventarwert pro Aktie	88.01	81.74	105.93
Im Umlauf befindliche Aktien	10 000.00	10 000.00	10 000.00
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -I USD dist- LU1835934719			
Nettovermögen	1 051 689.25	1 039 924.55	1 960 392.96
Nettoinventarwert pro Aktie	73.84	73.02	100.20
Im Umlauf befindliche Aktien	14 241.64	14 241.64	19 564.80
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -M USD acc- LU1835935013			
Nettovermögen	262 355.87	579 420.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	84.63	78.30	-
Im Umlauf befindliche Aktien	3 100.00	7 400.00	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -P USD acc- LU1835934123			
Nettovermögen	5 423 704.45	5 407 189.36	15 816 456.20
Nettoinventarwert pro Aktie	84.89	79.67	104.14
Im Umlauf befindliche Aktien	63 888.97	67 869.83	151 876.86
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -P USD dist- LU1835934396			
Nettovermögen	2 625 725.79	4 079 871.85	6 062 400.73
Nettoinventarwert pro Aktie	73.26	72.47	99.37
Im Umlauf befindliche Aktien	35 840.84	56 297.39	61 008.36
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -Y USD acc- LU1835934800			
Nettovermögen	3 922 920.80	4 267 799.03	15 184 102.80
Nettoinventarwert pro Aktie	87.89	81.66	105.76
Im Umlauf befindliche Aktien	44 637.57	52 263.03	143 571.32
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -Y USD dist- LU1835934982			
Nettovermögen	6 164 873.11	8 244 466.78	22 741 478.51
Nettoinventarwert pro Aktie	73.63	72.84	99.97
Im Umlauf befindliche Aktien	83 730.82	113 185.98	227 483.03
JSS Equity - All China -C CHF acc- LU1965940783			
Nettovermögen	15 109 916.24	23 811 076.52	33 471 357.19
Nettoinventarwert pro Aktie	79.36	118.31	161.04
Im Umlauf befindliche Aktien	190 397.13	201 260.05	207 844.99

Nettoinventarwertaufstellung (Fortsetzung)

	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2021
JSS Equity - All China -C EUR acc- LU1965940510			
Nettovermögen	17 958 609.89	27 252 201.63	35 680 625.58
Nettoinventarwert pro Aktie	88.85	129.18	160.55
Im Umlauf befindliche Aktien	202 122.79	210 963.01	222 239.96
JSS Equity - All China -C USD acc- LU1900873875			
Nettovermögen	34 293 064.85	58 570 502.44	97 539 786.53
Nettoinventarwert pro Aktie	86.89	121.07	170.68
Im Umlauf befindliche Aktien	394 672.17	483 773.87	571 477.54
JSS Equity - All China -C USD dist- LU1900873958			
Nettovermögen	3 541 367.92	4 957 300.95	13 033 661.94
Nettoinventarwert pro Aktie	86.90	121.08	170.70
Im Umlauf befindliche Aktien	40 752.22	40 942.36	76 354.20
JSS Equity - All China -I CHF acc- LU1965941161			
Nettovermögen	5 839 219.57	9 640 892.93	6 344 229.30
Nettoinventarwert pro Aktie	80.36	119.39	161.95
Im Umlauf befindliche Aktien	72 663.26	80 751.26	39 174.00
JSS Equity - All China -I EUR acc- LU1965940940			
Nettovermögen	1 205 464.00	1 812 004.00	6 427 556.02
Nettoinventarwert pro Aktie	89.96	130.36	161.44
Im Umlauf befindliche Aktien	13 400.00	13 900.00	39 813.90
JSS Equity - All China -I USD acc- LU1900874097			
Nettovermögen	25 964 714.16	66 245 813.95	222 915 213.86
Nettoinventarwert pro Aktie	88.00	122.18	171.65
Im Umlauf befindliche Aktien	295 053.57	542 198.51	1 298 661.31
JSS Equity - All China -I10 USD acc- LU2273125992			
Nettovermögen	21 857 198.95	30 887 097.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	61.17	84.85	-
Im Umlauf befindliche Aktien	357 318.93	364 020.00	-
JSS Equity - All China -P CHF acc- LU1965940353			
Nettovermögen	10 450 617.40	16 378 211.41	22 674 790.48
Nettoinventarwert pro Aktie	78.23	117.10	160.04
Im Umlauf befindliche Aktien	133 588.36	139 865.17	141 682.02
JSS Equity - All China -P CHF dist- LU1965940437			
Nettovermögen	1 430 313.26	2 227 678.13	3 026 881.61
Nettoinventarwert pro Aktie	78.24	117.11	160.05
Im Umlauf befindliche Aktien	18 281.10	19 022.10	18 912.10
JSS Equity - All China -P EUR acc- LU1965940197			
Nettovermögen	12 142 542.14	22 718 739.62	33 016 616.46
Nettoinventarwert pro Aktie	87.59	127.87	159.55
Im Umlauf befindliche Aktien	138 629.32	177 670.60	206 935.86
JSS Equity - All China -P USD acc- LU1900873529			
Nettovermögen	126 605 988.23	204 584 531.27	341 150 313.23
Nettoinventarwert pro Aktie	85.67	119.85	169.64
Im Umlauf befindliche Aktien	1 477 833.41	1 707 004.85	2 011 025.19
JSS Equity - All China -P USD dist- LU1900873792			
Nettovermögen	11 349 112.69	17 277 976.30	21 288 240.65
Nettoinventarwert pro Aktie	85.67	119.85	169.64
Im Umlauf befindliche Aktien	132 474.76	144 163.34	125 490.69

Fondsperformance**/**

Performance der Aktienklasse in % pro Kalenderjahr

	Wahrung der Aktienklasse	(31.12.2022- 30.06.2023) (laufende Berichtsperiode)	(31.12.2021- 31.12.2022)	(31.12.2020- 31.12.2021)	(31.12.2019- 31.12.2020)
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C CHF acc hedged-	CHF	0.23	-17.20	-2.48	-*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C EUR acc hedged-	EUR	1.03	-16.97	-2.31	-*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C USD acc-	USD	2.37	-15.06	-1.37	7.38
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C USD dist-	USD	2.37	-15.06	-1.37	7.41
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I USD acc-	USD	2.46	-14.89	-1.17	7.60
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I USD dist-	USD	2.46	-14.90	-1.17	7.61
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P CHF acc hedged-	CHF	0.01	-17.59	-2.87	4.74
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P EUR acc hedged-	EUR	0.82	-17.34	-2.75	4.76
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P EUR dist hedged-	EUR	0.81	-17.35	-2.71	4.80
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P USD acc-	USD	2.14	-15.43	-1.82	6.93
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P USD dist-	USD	2.13	-15.44	-1.81	6.93
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y CHF acc hedged-	CHF	0.42	-16.93	-2.12	5.57
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y CHF dist hedged-	CHF	0.41	-16.95	-	-*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y EUR acc hedged-	EUR	1.19	-16.65	-1.99	5.60
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y EUR dist hedged-	EUR	1.21	-16.67	-	-*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y GBP dist hedged-	GBP	1.87	-15.26	-	-*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y USD acc-	USD	2.54	-14.75	-1.03	7.77
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y USD dist-	USD	2.55	-14.76	-	-*
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -C USD acc-	USD	2.94	-23.72	-12.16	5.14
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -C USD dist-	USD	2.94	-23.73	-12.16	5.13
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -I USD acc-	USD	3.09	-23.51	-	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -P USD dist-	USD	2.69	-24.11	-12.60	4.54
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C EUR acc-	EUR	3.25	-0.27	28.26	-*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C EUR dist-	EUR	3.25	-0.28	28.27	-1.56
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C USD acc-	USD	5.54	-6.41	19.22	-*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C USD dist-	USD	5.55	-6.41	-	-*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -E USD acc-	USD	5.39	-6.69	18.87	-*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -E USD dist-	USD	5.39	-6.68	18.86	-*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -I USD acc-	USD	5.70	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -M USD acc-	USD	6.10	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P EUR acc-	EUR	3.00	-0.78	27.63	-2.21
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P EUR dist-	EUR	3.00	-0.77	27.63	-2.06
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P USD acc-	USD	5.29	-6.88	18.62	6.59
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P USD dist-	USD	5.29	-6.87	-	-*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -S EUR acc-	EUR	3.38	-0.03	28.59	-1.49
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -S EUR dist-	EUR	3.38	-0.03	28.59	-1.22
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y USD acc-	USD	5.76	-6.04	19.69	-*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y USD dist-	USD	5.76	-6.04	19.69	-*
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) -C CHF acc-	CHF	3.06	-20.80	2.33	8.54
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) -C CHF dist-	CHF	3.06	-20.81	2.33	8.53
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) -P CHF dist-	CHF	2.80	-21.20	1.83	8.03
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -C EUR acc-	EUR	4.09	-19.58	4.85	7.48
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -C EUR dist-	EUR	4.08	-19.58	4.85	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -P EUR dist-	EUR	3.83	-19.98	4.33	6.96
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -S EUR acc-	EUR	4.21	-19.38	5.11	7.77
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR) -P EUR acc-	EUR	6.46	-19.68	8.76	8.73
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C CHF acc hedged-	CHF	-0.33	-13.14	0.69	0.32
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C EUR acc-	EUR	0.63	-12.57	1.02	0.69
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C GBP acc hedged-	GBP	1.18	-11.49	1.53	0.66
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C USD acc hedged-	USD	1.71	-11.03	1.68	2.15
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I CHF acc hedged-	CHF	-0.02	-12.68	1.18	0.45
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I EUR acc-	EUR	0.93	-12.11	1.53	1.12
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I USD acc hedged-	USD	2.01	-10.59	2.18	2.61
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I USD dist hedged-	USD	2.02	-10.50	2.29	-*
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I10 EUR acc-	EUR	0.94	-12.07	1.74	-*
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I3 CHF acc hedged-	CHF	-0.03	-12.66	1.33	-*
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 CHF acc hedged-	CHF	0.02	-12.60	1.44	-*

* Aufgrund der Auflegung/Auflosung der Klasse im Geschaftsjahr wurde fur diese Klasse keine Performance berechnet.

** Die Performance in der Vergangenheit ist kein zuverlassiger Hinweis auf die zukunftige Wertentwicklung. Bei der Performanceberechnung werden allfallige bei Zeichnung und Rucknahme von Aktien erhobene Kommissionen und Kosten nicht berucksichtigt. Dividenden sind jedoch in der Performanceberechnung enthalten.

*** Siehe Erluterung 17.

Fondsperformance**/** (Fortsetzung)

Performance der Aktienklasse in % pro Kalenderjahr

	Wahrung der Aktienklasse	(31.12.2022- 30.06.2023) (laufende Berichtsperiode)	(31.12.2021- 31.12.2022)	(31.12.2020- 31.12.2021)	(31.12.2019- 31.12.2020)
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 EUR acc-	EUR	0.97	-12.01	1.78	1.42
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 GBP dist hedged-	GBP	1.53	-	-	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I23 CHF acc hedged-	CHF	-0.05	-12.67	1.34	.*
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I23 EUR acc-	EUR	0.91	-12.10	1.69	.*
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I23 EUR dist-	EUR	0.92	-12.11	1.69	.*
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I10 CHF acc hedged-	CHF	0.20	-12.18	1.38	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I210 CHF acc hedged-	CHF	0.20	-	-	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I210 USD acc hedged-	USD	2.03	-	-	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I210 GBP acc hedged-	GBP	1.49	-	-	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P CHF acc hedged-	CHF	-0.38	-13.21	0.60	-0.04
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P EUR acc-	EUR	0.57	-12.65	0.93	0.60
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P EUR dist-	EUR	0.58	-12.66	0.93	0.60
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P USD acc hedged-	USD	1.65	-11.12	1.60	2.04
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P USD dist hedged-	USD	1.65	-11.14	1.58	2.04
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C CHF acc-	CHF	10.86	-26.39	14.70	.*
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C EUR acc-	EUR	12.16	-22.75	19.73	15.62
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C EUR dist-	EUR	12.16	-22.76	19.74	15.64
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C USD acc-	USD	14.66	-27.50	11.28	26.06
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I EUR acc-	EUR	12.24	-22.65	19.90	15.80
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD (BRL hedged) acc-	USD	29.87	-17.08	7.13	.*
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD acc-	USD	14.73	-27.41	11.43	26.22
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD dist-	USD	14.74	-27.41	11.43	26.23
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 CHF acc-	CHF	11.23	-25.93	15.44	.*
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 EUR acc-	EUR	12.52	-22.26	20.50	16.34
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 USD acc-	USD	15.02	-27.05	-	.*
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I30 CHF acc-	CHF	11.25	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I11 NOK acc-	NOK	13.65	-27.50	12.52	.*
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -M EUR acc-	EUR	12.80	-21.85	-	.*
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P EUR acc-	EUR	11.88	-23.14	19.14	15.06
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P EUR dist-	EUR	11.88	-23.14	19.14	15.07
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P SGD acc-	EUR	15.41	-28.25	.*	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P USD acc-	USD	14.37	-27.86	10.72	25.43
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P USD dist-	USD	14.37	-27.87	10.72	25.42
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -S EUR dist-	EUR	12.43	-22.36	20.33	.*
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -Y EUR acc-	EUR	12.52	-22.26	20.50	16.40
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -Y USD dist-	USD	15.03	-27.03	-	.*
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C CHF acc hedged-	CHF	0.22	-8.57	-1.40	.*
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C EUR acc hedged-	EUR	0.97	-8.29	-1.23	.*
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C EUR dist hedged-	EUR	1.14	-8.11	-1.23	.*
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C USD acc-	USD	2.30	-6.28	-0.29	3.39
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C USD dist-	USD	2.30	-6.28	-0.29	3.38
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -I USD acc-	USD	2.36	-6.14	-0.17	3.52
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P CHF acc hedged-	CHF	0.11	-8.67	-1.49	1.43
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P EUR acc hedged-	EUR	0.96	-8.48	-1.34	1.60
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P USD acc-	USD	2.25	-6.37	-0.40	3.28
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P USD dist-	USD	2.24	-6.37	-0.39	3.27
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y CHF acc hedged-	CHF	0.34	-8.26	-1.23	1.78
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y EUR acc hedged-	EUR	1.13	-8.00	-0.90	1.99
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y USD dist-	USD	2.45	-6.00	-	3.68
JSS Sustainable Bond CHF -C CHF acc-	CHF	1.39	-7.96	-1.42	-0.15
JSS Sustainable Bond CHF -M CHF acc-	CHF	1.60	-7.60	-1.03	0.24
JSS Sustainable Bond CHF -P CHF dist-	CHF	1.27	-8.19	-1.67	-0.41
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C CHF acc hedged-	CHF	0.33	-17.53	-3.26	.*
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C EUR acc-	EUR	1.29	-17.07	-2.95	5.61
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C EUR dist-	EUR	1.29	-17.06	-2.96	.*
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -I EUR acc-	EUR	1.41	-16.84	-2.73	.*
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P CHF dist hedged-	CHF	0.21	-17.80	-	.*

* Aufgrund der Auflegung/Auflosung der Klasse im Geschaftsjahr wurde fur diese Klasse keine Performance berechnet.

** Die Performance in der Vergangenheit ist kein zuverlassiger Hinweis auf die zukunftige Wertentwicklung. Bei der Performanceberechnung werden allfallige bei Zeichnung und Rucknahme von Aktien erhobene Kommissionen und Kosten nicht berucksichtigt. Dividenden sind jedoch in der Performanceberechnung enthalten.

*** Siehe Erlauterung 17.

Fondsperformance**/** (Fortsetzung)

Performance der Aktienklasse in % pro Kalenderjahr

	Wahrung der Aktienklasse	(31.12.2022- 30.06.2023) (laufende Berichtsperiode)	(31.12.2021- 31.12.2022)	(31.12.2020- 31.12.2021)	(31.12.2019- 31.12.2020)
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P EUR acc	EUR	1.17	-	-	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P EUR dist-	EUR	1.17	-17.28	-3.20	5.35
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y CHF acc hedged-	CHF	0.23	-17.45	-3.14	.*
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y EUR acc-	EUR	1.35	-16.99	-2.86	5.74
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y EUR dist-	EUR	1.34	-16.99	-2.87	.*
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -C EUR acc-	EUR	1.23	-14.98	-0.71	4.05
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -C EUR dist-	EUR	1.23	-14.98	-0.70	.*
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -I EUR acc-	EUR	1.30	-14.86	-0.56	4.20
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -M EUR acc-	EUR	1.46	-14.61	-0.27	4.52
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -P EUR dist-	EUR	1.10	-15.19	-0.95	3.79
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -Y CHF dist hedged-	CHF	0.37	-15.51	-	.*
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -Y EUR acc-	EUR	1.31	-14.85	-0.56	4.21
JSS Sustainable Equity - Europe -C EUR acc-	EUR	9.70	-11.61	20.73	-4.04
JSS Sustainable Equity - Europe -P EUR acc-	EUR	9.51	-11.93	20.31	-4.55
JSS Sustainable Equity - Europe -P EUR dist-	EUR	9.50	-11.92	20.31	-4.55
JSS Sustainable Equity - Europe -P USD acc-	USD	11.95	-17.34	11.82	4.23
JSS Sustainable Equity - Europe -Y EUR acc-	EUR	10.03	-11.09	21.47	-3.63
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C CHF acc-	CHF	10.52	-21.29	-	.*
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C EUR acc-	EUR	11.80	-17.41	26.15	5.69
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C USD acc-	USD	14.27	-22.48	-	.*
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -I EUR acc-	EUR	11.93	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -M CHF acc-	CHF	11.08	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -M EUR acc-	EUR	12.38	-16.54	27.48	6.81
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -P EUR dist-	EUR	11.52	-17.82	25.22	5.03
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -P USD acc-	USD	14.01	-22.87	16.39	14.70
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -C EUR acc-	EUR	-3.44	-24.70	29.67	-15.77
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -C EUR dist-	EUR	-3.44	-27.78	29.64	-15.77
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -I EUR acc-	EUR	-3.38	-24.59	29.83	-15.66
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P EUR acc-	EUR	-3.68	-25.07	29.02	-16.19
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P EUR dist-	EUR	-3.68	-25.06	29.01	-16.19
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P USD acc-	USD	-1.53	-29.68	19.58	-8.66
JSS Sustainable Equity - USA -C USD acc-	USD	15.54	-19.00	25.36	20.72
JSS Sustainable Equity - USA -I USD dist-	USD	15.73	-18.72	25.55	.*
JSS Sustainable Equity - USA -I10 USD acc-	USD	15.78	-	-	-
JSS Sustainable Equity - USA -P USD acc-	USD	15.30	-19.32	24.74	20.12
JSS Sustainable Equity - USA -P USD dist-	USD	15.30	-19.32	24.74	.*
JSS Sustainable Equity - USA -Y USD acc-	USD	15.88	-18.51	26.12	21.22
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C EUR acc-	EUR	0.37	-12.01	.*	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I EUR dist-	EUR	0.57	-	-	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I H2 CHF dist-	CHF	-0.47	-13.81	-	.*
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I USD H2 acc-	USD	2.06	-13.74	-	.*
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P CHF H2 acc-	CHF	-0.86	-14.49	10.36	4.39
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P EUR acc-	EUR	0.14	-12.42	.*	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P EUR dist-	EUR	0.14	-12.43	13.15	4.72
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P USD H2 acc-	USD	1.63	-14.42	.*	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C CHF H1 acc-	CHF	10.78	-21.80	26.11	16.15
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C EUR acc-	EUR	10.84	-17.43	29.96	16.52
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C EUR dist-	EUR	10.83	-17.43	29.96	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C USD acc-	USD	13.31	-22.51	-	.*
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C USD dist-	USD	13.30	-22.51	-	.*
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I CHF acc-	CHF	9.89	-20.85	-	.*
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I EUR acc-	EUR	11.16	-16.94	30.30	16.66
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I EUR dist-	EUR	11.16	-16.94	30.28	.*
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P CHF H1 acc-	CHF	10.58	-22.14	25.33	15.36
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P EUR acc-	EUR	10.62	-17.79	29.12	15.73
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P EUR dist-	EUR	10.61	-17.79	29.12	15.73
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P GBP dist-	GBP	6.99	-13.13	-	.*

* Aufgrund der Auflegung/Auflosung der Klasse im Geschaftsjahr wurde fur diese Klasse keine Performance berechnet.

** Die Performance in der Vergangenheit ist kein zuverlassiger Hinweis auf die zukunftige Wertentwicklung. Bei der Performanceberechnung werden allfallige bei Zeichnung und Rucknahme von Aktien erhobene Kommissionen und Kosten nicht berucksichtigt. Dividenden sind jedoch in der Performanceberechnung enthalten.

*** Siehe Erluterung 17.

Fondsperformance**/** (Fortsetzung)

Performance der Aktienklasse in % pro Kalenderjahr

	Wahrung der Aktienklasse	(31.12.2022- 30.06.2023) (laufende Berichtsperiode)	(31.12.2021- 31.12.2022)	(31.12.2020- 31.12.2021)	(31.12.2019- 31.12.2020)
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P USD H1 acc-	USD	13.02	-19.24	26.79	17.63
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P USD dist-	USD	13.08	-22.85	20.01	26.39
JSS Sustainable Equity - Green Planet -S EUR dist-	EUR	11.03	-17.14	30.42	16.89
JSS Sustainable Equity - Green Planet -Y EUR acc-	EUR	11.25	-16.81	30.74	17.13
JSS Bond - USD High Yield -C EUR acc hedged-	EUR	3.46	-14.94	5.82	4.61
JSS Bond - USD High Yield -C USD acc-	USD	4.83	-12.65	6.83	6.56
JSS Bond - USD High Yield -C USD dist-	USD	4.83	-12.65	6.83	6.56
JSS Bond - USD High Yield -I USD acc-	USD	4.96	-12.45	7.09	6.81
JSS Bond - USD High Yield -I USD dist-	USD	4.95	-12.44	7.09	6.81
JSS Bond - USD High Yield -P CHF acc hedged-	CHF	2.42	-15.30	5.26	3.93
JSS Bond - USD High Yield -P CHF dist hedged-	CHF	2.48	-15.49	5.33	3.96
JSS Bond - USD High Yield -P EUR acc hedged-	EUR	3.30	-14.97	5.56	4.18
JSS Bond - USD High Yield -P EUR dist hedged-	EUR	3.33	-15.09	5.49	4.03
JSS Bond - USD High Yield -P USD acc-	USD	4.67	-12.91	6.51	6.24
JSS Bond - USD High Yield -P USD dist-	USD	4.68	-12.92	6.52	6.24
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C CHF acc hedged-	CHF	0.18	-13.29	-3.36	4.30
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C EUR acc hedged-	EUR	1.04	-12.96	-3.19	4.53
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C USD acc-	USD	2.40	-10.84	-2.21	6.23
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C USD dist-	USD	2.41	-10.84	-2.21	6.24
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I CHF acc hedged-	CHF	0.31	-13.12	-3.18	4.34
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I EUR acc hedged-	EUR	1.15	-12.84	-3.02	4.52
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I EUR dist hedged-	EUR	1.19	-12.76	-2.99	4.83
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I USD acc-	USD	2.51	-10.68	-2.03	6.44
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I USD dist-	USD	2.50	-10.67	-2.03	6.44
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -M CHF acc hedged-	CHF	0.53	-12.84	-2.81	4.80
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P CHF acc hedged-	CHF	0.14	-13.56	-3.69	3.79
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P EUR acc hedged-	EUR	0.90	-13.24	-3.54	4.12
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P EUR dist hedged-	EUR	0.91	-13.25	-3.57	4.15
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P USD acc-	USD	2.23	-11.14	-2.55	5.87
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P USD dist-	USD	2.22	-11.14	-2.56	5.86
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y CHF acc hedged-	CHF	0.37	-13.05	-3.07	4.54
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y EUR acc hedged-	EUR	1.25	-12.63	-2.91	4.69
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y GBP dist hedged-	GBP	1.89	-11.37	-2.24	5.68
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y USD acc-	USD	2.55	-10.56	-1.93	6.50
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y USD dist-	USD	2.56	-10.57	-1.92	6.51
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C EUR acc-	EUR	17.86	-22.93	20.25	15.53
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C EUR dist-	EUR	17.86	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C USD acc-	USD	20.48	-27.66	11.75	26.20
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -E EUR acc-	EUR	17.75	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -E EUR dist-	EUR	17.77	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P EUR acc-	EUR	17.50	-23.38	19.52	14.87
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P EUR dist-	EUR	17.50	-23.38	19.51	14.84
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P USD acc-	USD	20.12	-28.10	11.09	25.42
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P USD dist-	USD	20.12	-28.10	11.08	25.43
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C CHF acc-	CHF	31.60	-37.27	19.57	35.92
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C EUR acc-	EUR	33.14	-34.17	24.81	36.44
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C USD acc-	USD	36.10	-38.22	16.00	49.02
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C USD dist-	USD	36.10	-38.22	16.00	49.02
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -E USD acc-	USD	35.90	-38.40	15.65	48.57
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -E USD dist-	USD	35.90	-38.40	15.65	48.57
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I CHF acc-	CHF	31.75	-37.12	-	-*
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I USD (BRL hedged) acc-	USD	53.35	-29.81	-	-*
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I USD acc-	USD	36.27	-38.08	16.28	49.37
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I10 USD acc-	USD	36.33	-38.01	-*	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -M USD acc-	USD	36.78	-42.41	17.04	50.41
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P CHF dist-	CHF	31.22	-37.64	18.86	35.09
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P EUR acc-	EUR	32.74	-34.56	24.06	35.63

* Aufgrund der Auflegung/Auflosung der Klasse im Geschaftsjahr wurde fur diese Klasse keine Performance berechnet.

** Die Performance in der Vergangenheit ist kein zuverlassiger Hinweis auf die zukunftige Wertentwicklung. Bei der Performanceberechnung werden allfallige bei Zeichnung und Rucknahme von Aktien erhobene Kommissionen und Kosten nicht berucksichtigt. Dividenden sind jedoch in der Performanceberechnung enthalten.

*** Siehe Erluterung 17.

Fondsperformance**/** (Fortsetzung)

Performance der Aktienklasse in % pro Kalenderjahr

	Wahrung der Aktienklasse	(31.12.2022- 30.06.2023) (laufende Berichtsperiode)	(31.12.2021- 31.12.2022)	(31.12.2020- 31.12.2021)	(31.12.2019- 31.12.2020)
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P EUR dist-	EUR	32.74	-34.56	24.06	35.63
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P USD acc-	USD	35.69	-38.58	15.30	48.13
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P USD dist-	USD	35.70	-38.59	15.31	48.13
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -Y USD acc-	USD	36.38	-37.97	16.44	49.61
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -Y USD dist-	USD	36.37	-37.96	16.46	49.61
JSS Sust. Bond - Emerging Markets Local Currency -C USD acc-	USD	1.74	-12.47	-10.09	2.46
JSS Sust. Bond - Emerging Markets Local Currency -C USD dist-	USD	1.75	-12.47	-10.09	2.46
JSS Sust. Bond - Emerging Markets Local Currency -I USD acc-	USD	2.04	-12.07	-9.79	2.80
JSS Sust. Bond - Emerging Markets Local Currency -I USD dist-	USD	2.04	-12.08	-9.79	2.81
JSS Sust. Bond - Emerging Markets Local Currency -M USD acc-	USD	2.24	-11.66	-*	-
JSS Sust. Bond - Emerging Markets Local Currency -P USD acc-	USD	1.48	-12.91	-10.54	1.95
JSS Sust. Bond - Emerging Markets Local Currency -P USD dist-	USD	1.48	-12.91	-10.53	1.94
JSS Sust. Bond - Emerging Markets Local Currency -Y USD acc-	USD	2.03	-12.07	-9.73	2.87
JSS Sust. Bond - Emerging Markets Local Currency -Y USD dist-	USD	2.02	-12.07	-9.73	2.86
JSS Equity - All China -C CHF acc-	CHF	-10.75	-31.44	-11.40	46.28
JSS Equity - All China -C EUR acc-	EUR	-9.72	-28.10	-7.06	46.25
JSS Equity - All China -C USD acc-	USD	-7.72	-32.28	-14.38	60.55
JSS Equity - All China -C USD dist-	USD	-7.72	-32.28	-14.38	60.56
JSS Equity - All China -I CHF acc-	CHF	-10.61	-31.19	-11.07	46.79
JSS Equity - All China -I EUR acc-	EUR	-9.57	-27.86	-6.73	46.75
JSS Equity - All China -I USD acc-	USD	-7.55	-32.05	-14.08	61.12
JSS Equity - All China -I10 USD acc-	USD	-7.51	-31.98	-*	-
JSS Equity - All China -P CHF acc-	CHF	-10.95	-31.70	-11.75	45.66
JSS Equity - All China -P CHF dist-	CHF	-10.94	-31.70	-11.75	45.67
JSS Equity - All China -P EUR acc-	EUR	-9.91	-28.39	-7.43	45.64
JSS Equity - All China -P USD acc-	USD	-7.90	-32.56	-14.73	59.90
JSS Equity - All China -P USD dist-	USD	-7.91	-32.55	-14.73	59.90

* Aufgrund der Auflegung/Auflosung der Klasse im Geschaftsjahr wurde fur diese Klasse keine Performance berechnet.

** Die Performance in der Vergangenheit ist kein zuverlassiger Hinweis auf die zukunftige Wertentwicklung. Bei der Performanceberechnung werden allfallige bei Zeichnung und Rucknahme von Aktien erhobene Kommissionen und Kosten nicht berucksichtigt. Dividenden sind jedoch in der Performanceberechnung enthalten.

*** Siehe Erluterung 17.

Bericht der Anlageverwalter

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency

Während des Berichtszeitraums erzielte der JSS Sustainable Bond – Emerging Markets Local Currency P USD acc auf absoluter Basis eine Rendite von 14.02%. Der Fonds verzeichnete eine starke positive absolute Rendite und übertraf die Benchmark während des Beobachtungszeitraums deutlich. Wir hatten eine Risikoübergewichtung im Fonds vor dem Hintergrund attraktiver Bewertungen und der Erwartung einer positiven Wirtschaftsdynamik für viele Schwellenmärkte. Diese Erwartung wurde erfüllt, da Schwellenmarktwährungen und -anleihen von attraktiven Bewertungen und einer rückläufigen Inflation profitierten. Die Anlageklasse erholte sich stark, nachdem sie im vergangenen Jahr mit einem „perfekten Sturm“ geopolitischer, marktbezogener und fundamentaler Probleme zu kämpfen hatte. Am besten schnitt die Region Lateinamerika ab, in der der Fonds übergewichtete Positionen in Brasilien, Chile, Kolumbien und Mexiko hielt. Diese übergewichteten Positionen trugen erheblich zur relativen Outperformance des Fonds bei. Osteuropa verzeichnete ebenfalls hohe Renditen, wir waren jedoch in dieser Region aufgrund schwächerer Fundamentaldaten und erhöhter geopolitischer Risiken mit einem neutralen Nettoengagement vorsichtiger. Asien als Region schnitt schwächer ab, wir hatten aber unsere übergewichtete Position in Indonesien, die ebenfalls eine starke positive Rendite lieferte und zur relativen Outperformance des Fonds beitrug.

JSS Bond - USD High Yield

Während des Berichtszeitraums erzielte der JSS Bond – USD High Yield P USD acc auf absoluter Basis eine Performance von 6.52%. Die Gesamrendite des Fonds für den 12-monatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 lag unter der Rendite von 9.07% des Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped Index (BBHY2% ICI), dem breit angelegten Wertpapiermarktindex des Fonds. Im 12-monatigen Berichtszeitraum wurde die Performance des Fonds im Vergleich zum BBHY2% ICI vor allem durch die Wertentwicklung der Anleihen und der Allokation in Aktien beeinflusst. Im Vergleich zum BBHY2%ICI wirkte sich die Sektorallokation des Portfolios in Hochzinsanleihen negativ auf den Fonds aus. Die untergewichtete Allokation des Fonds im Freizeitsektor sowie die Übergewichtung der Sektoren Medien und Unterhaltung sowie Kabel und Satellit schmälerten die Performance. Der Fonds wurde während des Berichtszeitraums auch durch seine Barbestände belastet. Im Vergleich zum BBHY2%ICI wirkte sich die Titelauswahl im Hochzinsanleiheanteil des Portfolios negativ auf den Fonds aus. Dies galt insbesondere für die Sektoren Medien und Unterhaltung und Pharma. Der Fonds litt im Berichtszeitraum unter seiner Allokation in Aktienwerten, da seine Positionen hinter dem BBHY2%ICI zurückblieben. Die Aktienpositionen des Fonds, die die Performance des Fonds während des Berichtszeitraums am stärksten belasteten, waren Enviva, iHeartMedia und Cumulus Media. Die Aktienpositionen O-I Glass, Stagwell und GMS des Fonds leisteten während des Berichtszeitraums den größten Beitrag zur Performance.

JSS Equity - All China

Während des Beobachtungszeitraums erzielte der Fonds JSS Equity – All China P USD acc eine Rendite von -28.52%, während der MSCI China All Shares Index eine Rendite von -17.91% verbuchte. Das Gesundheitswesen leistete mit 1.1% einen positiven Beitrag zur Überschussrendite, während der Informationstechnologiesektor mit -3.4% die Überschussrendite am stärksten belastete. Im Berichtszeitraum wurde die chinesische Wirtschaft durch Covid-bedingte Störungen, die Immobilienkrise und geopolitische Spannungen beeinträchtigt. Nach der Wiedereröffnung zeigten die Konsumdaten und Verkaufszahlen von Neuimmobilien im 1. Quartal 2023 deutliche Anzeichen einer Erholung. Die Makrodaten schwächten sich jedoch im 2. Quartal ab, und die Anlegerstimmung wurde angesichts geopolitischer Spannungen, dem hinter den Erwartungen zurückbleibenden Wirtschaftswachstum und der Abwertung des CNY fragil. Zum 30. Juni war das Portfolio in den Bereichen Basiskonsumgüter und Informationstechnologie übergewichtet, während Nicht-Basiskonsumgüter und Grundstoffe untergewichtet waren. Wir sind auch weiterhin von erneuerbaren Energien und der fortschrittlichen Fertigung überzeugt. Wir sind außerdem der Ansicht, dass die aufsichtsrechtlichen Risiken von Internetunternehmen weiter abnehmen werden und dass einige qualitativ hochwertige Titel in Bezug auf ihre Bewertung attraktiv geworden sind.

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)

Während des Berichtszeitraums lag die Performance der JSS Sustainable Multi Asset – Thematic Balanced (CHF) P CHF dist auf absoluter Basis bei -1.37%. Der Fonds blieb in den 12 Monaten bis zum 30. Juni 2023 hinter der Benchmark zurück, was vor allem auf die Titelauswahl zurückzuführen ist. Siemens, ASML und Palo Alto waren die größten Beitragsleister und profitierten von ihrem technologischen Fähigkeiten, innovativen Lösungen und starken Marktpositionen. Dagegen waren SVB Financial, Entegris und International Foods and Flavors die größten Verlustbringer und schmälerten die Fondsperformance. Zu den bemerkenswerten Portfolioanpassungen zählt der Aufbau von Positionen in Shiseido und Reckitt Benckiser. Erstere wurde in Anbetracht der potenziellen Erholung der japanischen Einzelhandelsausgaben gekauft, während letztere ein defensives Engagement und stetige Umsätze bietet. Darüber hinaus veräußerte der Fonds seine Position in MSCI Inc. Was die Positionierung anbelangt, hat der Fonds im Laufe des Berichtszeitraums wieder in Anleihen investiert, um die sich nach dem Anstieg der europäischen Zinssätze bietenden Chancen auf steigende Bewertungen zu nutzen. Trotz der schwierigen Zeiten unterstreicht die Fokussierung des Fonds auf Unternehmen wie Siemens, ASML und Palo Alto Networks sein Engagement, thematische Anlagegelegenheiten innerhalb der sich entwickelnden Marktlandschaft zu identifizieren und zu nutzen. Die Bedingungen für solche Anlagen haben sich in den letzten drei Monaten verbessert, da der Höchststand der Zinssätze in Sicht ist und die Abzinsungssätze für künftige Wachstumschancen ab jetzt sinken dürften.

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)

Während des Berichtszeitraums lag die Performance der JSS Sustainable Multi Asset – Thematic Balanced (EUR) P EUR dist auf absoluter Basis bei -0.04%. Der Fonds blieb in den 12 Monaten bis zum 30. Juni 2023 hinter der Benchmark zurück, was vor allem auf die Titelauswahl zurückzuführen ist. Siemens, ASML und Palo Alto waren die größten Beitragsleister und profitierten von ihrem technologischen Fähigkeiten, innovativen Lösungen und starken Marktpositionen. Dagegen waren SVB Financial, Entegris und International Foods and Flavors die größten Verlustbringer und schmälerten die Fondsperformance. Zu den bemerkenswerten Portfolioanpassungen zählt der Aufbau von Positionen in Shiseido und Reckitt Benckiser. Erstere wurde in Anbetracht der potenziellen Erholung der japanischen Einzelhandelsausgaben gekauft, während letztere ein defensives Engagement und stetige Umsätze bietet. Darüber hinaus veräußerte der Fonds seine Position in MSCI Inc. Was die Positionierung anbelangt, hat der Fonds im Laufe des Berichtszeitraums wieder in Anleihen investiert, um die sich nach dem Anstieg der europäischen Zinssätze bietenden Chancen auf steigende Bewertungen zu nutzen.

Trotz der schwierigen Zeiten unterstreicht die Fokussierung des Fonds auf Unternehmen wie Siemens, ASML und Palo Alto Networks sein Engagement, thematische Anlagegelegenheiten innerhalb der sich entwickelnden Marktlandschaft zu identifizieren und zu nutzen. Die Bedingungen für solche Anlagen haben sich in den letzten drei Monaten verbessert, da der Höchststand der Zinssätze in Sicht ist und die Abzinsungssätze für künftige Wachstumschancen ab jetzt sinken dürften.

Bericht der Anlageverwalter (Fortsetzung)

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)

Während des Berichtszeitraums lag die Performance der JSS Sustainable Multi Asset – Thematic Balanced (EUR) P EUR acc auf absoluter Basis bei 3.31%. Der Fonds blieb in den 12 Monaten bis zum 30. Juni 2023 hinter der Benchmark zurück, was vor allem auf die Titelauswahl zurückzuführen ist. Siemens, ASML und Palo Alto waren die größten Beitragsleister und profitierten von ihrem technologischen Fähigkeiten, innovativen Lösungen und starken Marktpositionen. Dagegen waren SVB Financial, Entegris und International Foods and Flavors die größten Verlustbringer und schmälerten die Fondsperformance. Zu den bemerkenswerten Portfolioanpassungen zählt der Aufbau von Positionen in Shiseido und Reckitt Benckiser. Erstere wurde in Anbetracht der potenziellen Erholung der japanischen Einzelhandelsausgaben gekauft, während letztere ein defensives Engagement und stetige Umsätze bietet. Darüber hinaus veräußerte der Fonds seine Position in MSCI Inc. Was die Positionierung angeht, hat der Fonds im Laufe des Berichtszeitraums wieder in Anleihen investiert, um die sich nach dem Anstieg der europäischen Zinssätze bietenden Chancen auf steigende Bewertungen zu nutzen. Trotz der schwierigen Zeiten unterstreicht die Fokussierung des Fonds auf Unternehmen wie Siemens, ASML und Palo Alto Networks sein Engagement, thematische Anlagegelegenheiten innerhalb der sich entwickelnden Marktlandschaft zu identifizieren und zu nutzen. Die Bedingungen für solche Anlagen haben sich in den letzten drei Monaten verbessert, da der Höchststand der Zinssätze in Sicht ist und die Abzinsungssätze für künftige Wachstumschancen ab jetzt sinken dürften.

JSS Sustainable Bond - Global Short-Term

Während des Berichtszeitraums erzielte der JSS Sustainable Bond – Global Short Term Opportunistic P USD acc in einem sehr volatilen Umfeld eine positive Rendite von 3.22% auf absoluter Basis (3.6% für USD 3-Month Deposit Offered Rate bei konstanter Laufzeit). Der Fonds und generell die Rentenmärkte litten im September und Oktober 2022 unter einem von den US-Zinsen angetriebenen Abverkauf, der die Performance der ersten Monate in den negativen Bereich drückte (die Renditen von US-Staatsanleihen stiegen über die gesamte Kurve hinweg um 100 Bp. (auf 4.5% am kurzen Ende der Kurve). Die Performance erholte sich jedoch in den folgenden Monaten dank eines höheren Carry und einer selektiven Spread-Verengung. Im Februar 2023 kam es aufgrund der Regionalbankenkrise in den USA und des Zusammenbruchs der SVB zu einer weiteren Erschütterung. Das Ereignis führte zu einem vorübergehenden Anstieg der Spreads, bevor sie gegen Juni 2023 allmählich wieder auf ihre ursprünglichen Niveaus zurückkehrten. Dieses Risikoereignis belastete nachrangige Instrumente und Instrumente mit längerer Duration stärker als Anleihen mit kurzer Duration und wirkte sich daher weniger auf den Global Short Term Fund aus. Generell begannen wir den Berichtszeitraum sehr vorsichtig, nachdem wir den Anteil der Hochzinsanleihen bereits von ca. 20% auf ca. 10% reduziert hatten, wobei wir uns auf qualitativ hochwertige Schwellenmarktanleihen konzentrierten und bestrebt waren, anfällige Sektoren zu meiden (Ausstieg aus dem chinesischen Immobiliensektor). Dadurch konnte der Fonds Ausfälle in China und Lateinamerika vermeiden. Wir profitierten auch von der Inversion der Renditekurve, um einen höheren Carry zu erzielen, und beteiligten uns selektiv an Neuemissionen mit Investment-Grade-Rating und höheren Kupons.

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG

Während des Berichtszeitraums erzielte der JSS Sustainable Bond – Global Emerging Markets Corporate IG P USD acc in einem sehr volatilen Umfeld eine absolute positive Rendite von 1.53% (ca. 3.1% vor Abzug von Gebühren ggü. 2.5% der Benchmark JPM CEMBI BD IG). Der Fonds und generell die Rentenmärkte litten im September und Oktober 2022 unter einem von den US-Zinsen angetriebenen Abverkauf (die US-Renditen stiegen über die gesamte Kurve hinweg um 100 Bp. auf 4.2–4.5%), der die Performance der ersten Monate in den negativen Bereich drückte. Die Performance erholte sich jedoch in den folgenden Monaten dank eines höheren Carry und einer selektiven Spread-Verengung. Im Februar 2023 kam es aufgrund der Regionalbankenkrise in den USA und des Zusammenbruchs der SVB zu einer weiteren Erschütterung. Das Ereignis führte zu einem vorübergehenden Anstieg der Spreads, bevor sie gegen Juni 2023 wieder auf ihre ursprünglichen Niveaus zurückkehrten. Generell begannen wir den Berichtszeitraum sehr vorsichtig, nachdem wir den Anteil der Hochzinsanleihen bereits von ca. 20% auf ca. 7-8% reduziert hatten, wobei wir uns auf qualitativ hochwertige Schwellenmarktanleihen konzentrierten und bestrebt waren, anfällige Sektoren zu meiden (Ausstieg aus dem chinesischen Immobiliensektor). Dadurch konnte der Fonds Ausfälle in China und Lateinamerika vermeiden (darunter ein chinesisches Unternehmen, das zu Beginn des Berichtszeitraums zunächst mit IG bewertet wurde, und einzelne mit BB bewertete Schuldtitel in Brasilien). Wir konzentrierten unser Risiko auch auf Anleihen am kurzen Ende, um von der Inversion der Renditekurve zu profitieren, und nahmen opportunistisch hochwertige Anleihen mit langer Duration und niedriger Konvexität auf und behielten eine leichte Durationsübergewichtung bei. Angesichts der Entwicklungen bei den US-Renditen war die Duration während des Berichtszeitraums in der Regel ein relativer Hemmschuh für die Performance, den der Fonds durch positive Beiträge durch die Kreditauswahl aufgewogen hatte.

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates

Während des Berichtszeitraums erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Bond - EUR Corporates P EUR dist eine absolute Rendite von -1.24%. Die Duration des Fonds wurde im Berichtszeitraum aktiv verändert. Im Durchschnitt wurde er jedoch während des gesamten Berichtszeitraums kürzer als die Benchmark gehalten. Die Zinssätze stiegen in der zweiten Jahreshälfte 2022 aufgrund des schnellen Anstiegs der Inflation und des Zinserhöhungszyklus der Europäischen Zentralbank deutlich an. Im ersten Halbjahr 2023 schwankten die Zinssätze in einer breiten Spanne mit starken Auf- oder Abwärtsbewegungen. Auch die Kreditspreads wiesen sehr starke Bewegungen auf, insbesondere nach dem Zusammenbruch mehrerer US-Regionalbanken. Im Berichtszeitraum war die absolute Wertentwicklung somit negativ.

Die Performancetreiber des Fonds im Berichtszeitraum waren:

- Duration: Positive Bruttoperformance im Vergleich zur Benchmark
- Allokation: Positive Bruttoperformance im Vergleich zur Benchmark
- Auswahl: Negative Bruttoperformance im Vergleich zur Benchmark

JSS Sustainable Bond - Total Return Global

Während des Berichtszeitraums erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Bond - Total Return Global P USD acc eine absolute Rendite von 2.74% und übertraf damit die globalen Indizes. Der höhere Beitrag aus Erträgen in Verbindung mit der robusten Performance von Krediten und Devisen konnte die negativen Auswirkungen der weltweit steigenden Zinssätze mehr als ausgleichen. Die Vermögensallokation wurde im Jahresverlauf angesichts des wachsenden Rezessionsrisikos defensiver. Das Engagement und die Duration im Kreditsektor wurden reduziert. Die Staatsanleihen der Industrieländer wurden aufgestockt, da wir aufgrund steigender Realzinsen und sinkender Inflation eine selektiv konstruktive Haltung zur Duration einnehmen. Die US-Staatsanleihen wurden mit einer Laufzeit von ca. 5 bis 7 Jahren aufgestockt. Britische Gilts wurden hinzugefügt, da weitere Zinserhöhungen zu aggressiv eingepreist sind. Wir schlossen unsere relativen US-OAT-Positionen und unsere Short-Positionen im EUR, nachdem die EZB im ersten Halbjahr 2023 mit der US-Notenbank gleichgezogen hat. Wir stockten Short-Positionen in GJBs auf, da die Steuerung der Renditekurve in Japan nicht nachhaltig ist. Wir eröffneten auch eine Position in einem 5- bis 30-jährigen Steepener in den USA, da sich die Renditekurve auf extreme Niveaus umkehrte. Das Engagement in Fremdwährungen wurde in letzter Zeit nach der starken Performance des USD reduziert. Es wurden nur MNX und BRL beibehalten.

Bericht der Anlageverwalter (Fortsetzung)

JSS Sustainable Bond CHF

JSS Sustainable Bond CHF P CHF dist erzielte während des Berichtszeitraums eine Rendite von -0.04%. Die Duration des Fonds wurde erst am Ende des Berichtszeitraums geändert. Sie wurde kürzer gehalten als die Benchmark und im Juni 2023 auf eine neutrale Gewichtung erhöht. Dies wirkte sich im zweiten Halbjahr 2022 positiv auf die Performance aus. Stark steigende Inflationszahlen veranlassten die Zentralbanken, ihre Leitzinsen deutlich anzuheben. Dies führte zu einer starken Abflachung und schließlich zu einer Inversion der Renditekurve. Der Fonds könnte davon profitieren. Die Kreditspreads gingen im gesamten Berichtszeitraum leicht zurück. Der Fonds hat davon nur teilweise profitiert. Die Übergewichtung von Unternehmensanleihen leistete einen positiven Beitrag, während die Untergewichtung von Finanztiteln einen negativen Einfluss hatte.

Die Performancetreiber des Fonds im Berichtszeitraum waren:

- Duration: Positive Performance im Vergleich zur Benchmark
- Positionierung entlang der Renditekurve: Positive Performance im Vergleich zur Benchmark
- Allokation: Negative Performance im Vergleich zur Benchmark
- Auswahl: Positive Performance im Vergleich zur Benchmark

JSS Sustainable Bond EUR Broad

Im Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Bond EUR Broad P EUR dist eine absolute Rendite von -4.86%. Die Duration des Fonds wurde im Berichtszeitraum aktiv verändert. Im Durchschnitt wurde er jedoch während des gesamten Berichtszeitraums kürzer als die Benchmark gehalten. Die Zinssätze stiegen in der zweiten Jahreshälfte 2022 aufgrund des schnellen Anstiegs der Inflation und des Zinserhöhungszyklus der Europäischen Zentralbank deutlich an. Im ersten Halbjahr 2023 schwankten die Zinssätze in einer breiten Spanne mit starken Auf- oder Abwärtsbewegungen. Auch die Kreditspreads wiesen sehr starke Bewegungen auf, insbesondere nach dem Zusammenbruch mehrerer US-Regionalbanken. Im Berichtszeitraum war die absolute Wertentwicklung somit negativ.

Die Performancetreiber des Fonds im Berichtszeitraum waren:

- Duration: Positive Bruttoperformance im Vergleich zur Benchmark
- Allokation: Positive Bruttoperformance im Vergleich zur Benchmark
- Auswahl: Positive Bruttoperformance im Vergleich zur Benchmark

JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer

Während des Berichtszeitraums erzielte die Anteilsklasse SS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer P USD eine absolute Rendite von 24.43%. Der Fonds erzielte während des Berichtszeitraums eine starke positive Performance. Die starke Portfoliogewichtung von Unternehmen im Sektor zyklische Konsumgüter, die während des Berichtszeitraums verstärkt wurde, leistete einen positiven Beitrag. In diesem Sektor entwickelten sich Unternehmen im Bereich Luxusgüter und Reisen besonders gut. Auch im verbraucherorientierten Technologiebereich verzeichnete der Fonds eine starke positive Performance, insbesondere bei Leistungshalbleiterunternehmen, die den Markt für intelligente Mobilität bedienen. Hier reduzierte der Fonds sein Engagement gegen Ende des Berichtszeitraums etwas. Die Performance, wenngleich weiterhin positiv, wurde von defensiveren Unternehmen, z. B. aus dem Videospielektor oder Nahrungsmittel und Getränke etwas geschmälert.

JSS Sustainable Equity - Europe

Während des Berichtszeitraums erzielte der JSS Sustainable Equity – Europe P EUR dist eine Gesamtrendite von 14.70% für die Tranche P und blieb damit hinter dem MSCI Europe Net Return zurück. In der zweiten Jahreshälfte 2022 wurde nach einem anfänglichen Rückgang eine leicht positive Rendite verzeichnet. Die Anleger rechnen zunehmend mit einer moderaten Inflation, dem Ende steigender Zinsen und einer Abkühlung der Nachfrage aus. Dies bringt Volatilität mit sich, die Aktienmärkte haben sich aber als widerstandsfähig erwiesen. Insbesondere gegen Ende des Berichtszeitraums gewannen Technologieunternehmen wieder an Dynamik, da künstliche Intelligenz neuen Optimismus hervorbrachte.

Wir halten an unserem Kurs fest und konzentrieren unsere Anstrengungen auf die Auswahl von Unternehmen, die eine hohe Barrendite auf ihr Kapital in Verbindung mit einem realistischen Wachstumspfad aufweisen. Wir suchen Managementteams mit guten Kapitalallokationsfähigkeiten und behalten den Preis im Auge, den wir für diese Unternehmen zahlen. Da unsere Positionen ihre Gewinne mit hohen Renditen aufzinsen, tendieren die Marktwerte dazu, dies zu erkennen. Genau diese langfristige Einschätzung ermöglicht es uns, von unseren Fundamentalresearch-Bemühungen zu profitieren.

JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035

Der JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 P EUR dist erzielte während des Berichtszeitraums eine Performance von 13.03%. Der Klimawandel ist nach wie vor eine Herausforderung, die von uns verlangt, jetzt Maßnahmen zu ergreifen, um eine weitere globale Erwärmung zu vermeiden. Im Kern besteht die Notwendigkeit, die Kohlenstoffemissionen zu reduzieren. Die Strategie bevorzugt Unternehmen, die ihre eigenen CO2-Emissionen senken, und Unternehmen, die neue Lösungen anbieten, die anderen dabei helfen können, CO2-neutral zu werden, während gleichzeitig Stranded Assets wie fossile Brennstoffe vermieden werden. Im Berichtszeitraum entsprach die Performance weitgehend der Benchmark. Unsere Branchenallokation wirkte sich aufgrund unserer Übergewichtung von Hardware, Software und Halbleitern im Bereich Informationstechnologie und von Industrieausrüstungen im Bereich Industriewerte stark positiv auf die Performance aus. Der Rückgang des Ölpreises kam unserer Branchenallokation aufgrund unserer Untergewichtung im Energiesektor ebenfalls zugute. Unsere Stilallokation leistete aufgrund unserer Ausrichtung auf Aktien mit mittlerer Marktkapitalisierung einen leicht negativen Performancebeitrag aus. Auch unsere Titelauswahl belastete die Performance leicht. Wir halten an unserer Strategie fest, die am besten positionierten Titel für eine Welt mit geringerem CO2-Ausstoß zu finden, da bedeutende neue Investitionen weiterhin in Unternehmen übergehen werden, die den CO2-Fußabdruck verringern können.

JSS Sustainable Equity - Global Dividend

Der JSS Sustainable Equity - Global Dividend P USD acc erzielte während des Berichtszeitraums eine Performance von 13.24%. Die größten Änderungen bei der Sektorallokation waren eine höhere Allokation in zyklische Konsumgüter und Industriewerte sowie eine geringere Allokation in Finanzwerte, Basiskonsumgüter und Immobilien. Die höhere Allokation in zyklische Konsumgüter ist auf eine Erhöhung von Inditex und Home Depot zurückzuführen, die höhere Allokation in Industriewerte auf Kühne & Nagel und Caterpillar. Bei den Finanzwerten verkauften wir KeyCorp und bei den Immobiliertiteln verkauften wir Nexity. Der Fonds konzentriert sich weiterhin auf Unternehmen mit einer starken Bilanz (niedriger Verschuldungsgrad), guten operativen Cashflows und attraktiver Dividendenperspektive. Dieser Ansatz kam bis Ende Dezember 2022 insbesondere der relativen Performance zugute. Danach zeichnete sich eine deutliche Verringerung der Marktführerschaft auf eine kleine Anzahl von US-Wachstumsunternehmen mit erheblichem Engagement in KI ab. Diese Unternehmen sind jedoch aus Dividendensicht nicht attraktiv und werden daher nicht in unserer Strategie berücksichtigt. Aus fundamentaler Sicht erzielten die meisten unserer Unternehmen Ergebnisse, die über den Erwartungen lagen, und erhöhten ihre Dividendenausschüttung weiter.

Bericht der Anlageverwalter (Fortsetzung)

JSS Sustainable Equity - Global Thematic

Die Anteilsklasse JSS Sustainable Equity – Global Multifactor P EUR dist erzielte während des Berichtszeitraums auf absoluter Basis eine Performance von 7.27%. Der Fonds erzielte im Berichtszeitraum eine positive Rendite, blieb jedoch um 4% hinter der Benchmark zurück. Aus Sektorsicht leistete unsere Titelauswahl bei den Basiskonsumgütern den größten relativen Beitrag zur Rendite, wobei die Titel FEMSA und Shiseido hervorstachen. Im Bereich Kommunikationsdienste leistete unsere Übergewichtung von Meta einen erheblichen positiven Beitrag. Meta erzielte auch den größten relativen Beitrag über die 12 Monate, wobei Aramark und Booking ebenfalls einen positiven Beitrag leisteten. Unsere Untergewichtung im IT-Sektor schmälerte die Rendite. Dies steht im Zusammenhang mit unserer Aktienausswahl innerhalb des Sektors, da der Verzicht auf Nvidia, Apple und Broadcom der Performance abträglich war. Nvidia und Apple gehörten zu den Aktien, die die relative Performance am stärksten belasteten. IFF erwies sich als der größte Verlustbringer, aber auch ASOS und PayPal, die beide inzwischen verkauft wurden, schmälerten ebenfalls die Performance. Das Portfolio ist regional neutral, wobei unsere Titelauswahl in Asien und Europa die größten Belastungen darstellt. In Bezug auf neue Positionen haben wir vor allem unser Engagement in Unternehmen aus dem Themenbereich Klimawandel durch die Aufnahme von Positionen in Tetra Tech, Ecolab und Alstom erhöht.

JSS Sustainable Equity - Green Planet

In den 12 Monaten zum 30. Juni 2023 erzielte der JSS Sustainable Equity – Green Planet P EUR dist eine Rendite von 16.30%. Die Performance des Teilfonds profitierte von einer sich verbessernden Marktstimmung, da Europa im Zuge eines milden Winters eine Energiekrise vermeiden konnte, während China seine Null-Covid-Politik aufgab und das US-Wachstum trotz einer strafferen Geldpolitik solide blieb. Dies kam insbesondere den übergewichteten Positionen des Fonds in den Sektoren zyklische Industrie und Halbleiter zugute, die die Haupttreiber für die positive Jahresperformance waren. Im Jahresverlauf reduzierte der Fonds sein Engagement in PMI und zinsensitiven Aktien, z. B. im Baugewerbe. Der Fonds erhöhte sein Engagement in Nutznießern des Trends der „Green Reshoring“ (z. B. Investitionsgüter und Anbieter sauberer Technologie). Darüber hinaus wurden neue Positionen in Stromnetzunternehmen eröffnet, die kritische Infrastrukturen für den Übergang von Energie zu erneuerbaren Energien wie Wind und Sonne bereitstellen.

JSS Sustainable Equity - Real Estate Global

Während des Berichtszeitraums erzielte der JSS Sustainable Equity - Real Estate Global P EUR acc eine Performance auf absoluter Basis von -15.33%. Unsere Anlagen im Industriesektor entwickelten sich im Jahresverlauf nach einer früheren Schwäche positiv. Der Sektor war robust und wir profitierten von einer im Vergleich zur Benchmark übergewichteten Position. Die Titelauswahl in den USA trug generell positiv zu den Renditen bei, insbesondere im Wohnimmobiliensektor, obwohl einige Immobilieninvestmentgesellschaften (REITs) in den USA eine schwache Performance aufwiesen.

Unser Engagement in deutschen Wohnimmobiliengesellschaften wirkte sich negativ aus. Diese Unternehmen weisen in der Regel eine überdurchschnittlich hohe Verschuldung auf und litten unter steigenden Zinsen. Ein weiterer enttäuschender Bereich waren unsere Anlagen in Hongkong, die unter der Abschwächung der chinesischen Wirtschaft litten. Wir verloren auch an relativer Performance, da wir eine gegenüber der Benchmark untergewichtete Allokation in „Substanz“-REITs hatten. Im Hinblick auf Transaktionen verkauften wir unsere Position in Life Storage, einer Immobilieninvestmentgesellschaft, nachdem sie von einem anderen Unternehmen gekauft wurde.

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets

Die Anteilsklasse JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets P USD dist erzielte während des Berichtszeitraums eine absolute Rendite von -3.66%. Juni 2022 bis Juni 2023 war von einer Zeit geprägt, in der sich die Finanzmärkte änderten. Der Abwärtstrend der globalen und Schwellenmärkte im Jahr 2022 erreichte um den November die Talsohle, als die US-Inflation im Oktober unter den Prognosen lag und die Hoffnung auf einen Schwenk der US-Notenbank erhöhte und als China die Covid-Quarantänemaßnahmen lockerte, gab es Anzeichen für eine Wiederbelebung der Wirtschaft. Die Erholung der Aktienmärkte der Schwellenländer verlief seitdem unruhig, wobei sich attraktive Aktienbewertungen und die Erwartung positiver Impulse von der Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft als positive Treiber darstellten. Dies wurde jedoch durch die verknappte Liquidität eingedämmt, als die Zentralbanken den Leitzins immer weiter anhoben, um der steigenden Inflation zu begegnen. Zudem erwies sich das Szenario der Wiedereröffnung in China als schwach. Wachstumswerte aus Schwellenmärkten litten unter hohen Zinsbedingungen und einer Verlangsamung des Wachstums, wiesen eine Underperformance auf und belasteten die Fondspowerformance in den letzten 12 Monaten. Die Underperformance chinesischer Aktien aufgrund der inländischen Schwäche und geopolitischer Unsicherheiten belastete die Performance ebenfalls. Brasilianische Aktien entwickelten sich stark und leisteten einen positiven Beitrag zum Fonds.

JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors

In den 12 Monaten zum 30. Juni 2023 erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors P USD acc eine Rendite von 25.16%. Die Performance des Teilfonds wurde durch den Abverkauf am Markt in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums beeinträchtigt, der durch die Straffung der Geldpolitik durch die Zentralbanken beflügelt wurde. In der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums erholte sich die Performance des Fonds jedoch schnell, dank der sich verbessernden Stimmung gegenüber der Technologiebranche und des Engagements des Fonds in Generative AI, einer aufstrebenden Technologie. Im letzten Jahr nutzten wir die Marktvolatilität, um unser Portfolio zu konsolidieren. Wir erhöhten unser Engagement in unseren überzeugenden Halbleitertiteln, die von den dauerhaften und strukturellen Trends profitieren dürften. Auf der anderen Seite verkauften wir wachstumsstarke/unrentable Anlagen in Software und Consumer Internet.

JSS Sustainable Equity - USA

Während des Berichtszeitraums erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Equity - USA P USD acc eine absolute Rendite von 17.03%. Nach einem für US-Aktien schwierigen Jahr 2022 brachte die erste Jahreshälfte 2023 eine deutlich bessere Performance. Die Inflation scheint ihren Höhepunkt überschritten zu haben, und die erneute Begeisterung für Technologie und insbesondere für künstliche Intelligenz trieb die Märkte nach oben, und zwar viel höher als allgemein erwartet. Wie in den vergangenen Jahren haben wir die Stilengagements im Fonds sorgfältig verwaltet, sodass dieser Übergang der relativen Performance nicht schadete. Während des Berichtszeitraums entsprach die Bruttoperformance des Fonds in etwa derjenigen der Benchmark. Der JSS Sustainable Equity - USA profitierte von einer positiven Branchen- und Stilallokation, während die Titelauswahl etwas zurückblieb.

Wie so oft bleibt der makroökonomische Ausblick unsicher. Umso mehr sind wir bestrebt, ein ausgewogenes Portfolio zu halten und dabei unsere Anlagegrundsätze zu beachten, die auf Qualität, Dynamik, Bewertung und Nachhaltigkeit beruhen.

Bericht der Anlageverwalter (Fortsetzung)

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities

Im Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities P EUR dist eine absolute Performance von -2.48%. Zu Beginn des Beobachtungszeitraums wechselte das Global-Adaptive-Allocation-Modell, das unsere Anlagenallokation steuert, von der „mittleren“ in die „späte“ Phase des Konjunkturzyklus. Wir reduzierten das Engagement in Aktien, als sich der Marktzyklus auf die späte Phase zubewegte, und verringerten das Engagement in Kreditrisiken im Tausch gegen eine Erhöhung des Engagements in der Duration von Staatsanleihen. Außerdem haben wir innerhalb des Aktiensegments den Momentum-Faktor (von 50% auf 40% der Aktienquote) und den Value-Faktor (von 30% auf 10%) reduziert und den Quality-Faktor (von 20% auf 40%) stärker gewichtet. Der Low-Volatility-Faktor wurde mit einer Gewichtung von 10% der Aktienquote neu aufgenommen. Im November wechselte das Global Adaptive Allocation-Modell dann von der „späten Phase“ in die „Rezessionsphase“ des Konjunkturzyklus. Wir haben das Aktienengagement weiter reduziert und das Durationsengagement über Staatsanleihen mit langer Laufzeit weiter erhöht. Außerdem haben wir das Aktienportfolio zu 50% mit dem Quality-Faktor (der Aktienquote) und zu 50% mit dem Low-Volatility-Faktor positioniert.

JSS Twelve Sustainable Insurance Bond

Während des Berichtszeitraums erzielte die Anteilsklasse JSS Twelve Sustainable Insurance Bond Opp P EUR acc eine absolute Performance von 0.09%. Im zweiten Halbjahr 2022 dominierte die Inflation die Vermögensallokation an den Anleihemärkten, während sich die Zentralbanken darauf konzentrierten, die Zinssätze im Laufe des Jahres zu erhöhen. Die Short-Duration-Position im Fonds wurde beibehalten und bewegt sich weiterhin in einer Spanne von 3 bis 3,5 Jahren. Dies wurde durch unbefristete Short-Call-Anleihen, endfällige Strukturen und Anleihen mit kurzen Laufzeiten erreicht. Die daraus resultierende Strategie wirkte sich nicht auf die Rendite der erwarteten Rückkäufe des Fonds aus, die derzeit in EUR bei 6.8% liegt. Der Sektor selbst profitierte vom Umfeld steigender Zinsen und allein durch die organische Kapitalgenerierung. Die Solvabilitätskoeffizienten im Sektor stiegen im Durchschnitt um 10%, sodass der Solvabilitätskoeffizient der Branche in Europa derzeit insgesamt bei 223% liegt. Im ersten Quartal 2023 wurde der Finanzsektor von regionalen Bankenzusammenbrüchen in den USA und der durch die Übernahme der Credit Suisse durch die UBS ausgelösten AT1-Krise dominiert. Aus beiden Krisen ergaben sich keine Auswirkungen auf den Sektor der Versicherungsanleihen, abgesehen von einer geringfügigen Spreadausweitung bei Tier-One-Anleihen mit eingeschränkten Versicherungsbedingungen, die sich schnell erholten. Der Fonds hat weiterhin neue Zuflüsse verzeichnet und der NIW liegt derzeit bei 425 Millionen EUR.

BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGRÉÉ

Prüfungsurteil

Wir haben den Abschluss von JSS Investmentfonds (die „Gesellschaft“) und aller ihrer Teilfonds geprüft. Er umfasst die Aufstellung des Nettovermögens und die Aufstellung des Wertpapierbestands und sonstigen Nettovermögens zum 30. Juni 2023, die Ertrags- und Aufwandsrechnung, die Entwicklung des Nettovermögens für das zu diesem Zeitpunkt beendete Geschäftsjahr und die Erläuterungen zum Abschluss, darunter eine Zusammenfassung wichtiger Rechnungslegungsgrundsätze.

Nach unserer Auffassung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenslage der Gesellschaft und jedes ihrer Teilfonds zum 30. Juni 2023 sowie der Ergebnisse seiner Transaktionen und der Veränderung seines Nettovermögens für das zu diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Grundlage unseres Prüfungsurteils

Wir führten unsere Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über den Beruf des Abschlussprüfers („Gesetz vom 23. Juli 2016“) und den in Luxemburg von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) umgesetzten Internationalen Abschlussprüfungsgrundsätzen (ISA) durch. Unsere Verantwortlichkeiten gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISA sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten des 'Réviseur d'Entreprises Agréé' für die Prüfung des Jahresabschlusses“ in unserem Bericht näher beschrieben. Wir sind gemäß dem vom internationalen Rat für die Verabschiedung von Standards zur Berufsethik für Wirtschaftsprüfer (International Ethics Standards Board for Accountants, IESBA) herausgegebenen Kodex der ethischen Grundsätze für den Berufsstand (Code of Ethics for Professional Accountants – „IESBA-Code“) einschließlich der internationalen Unabhängigkeitsstandards (International Independence Standards) in der von der CSSF in Luxemburg umgesetzten Form sowie den für unsere Prüfung des Abschlusses relevanten ethischen Anforderungen von der Gesellschaft unabhängig und sind unserer sonstigen ethischen Verantwortung gemäß diesen Anforderungen gerecht geworden. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Andere Informationen

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft ist für die anderen Informationen verantwortlich. Die anderen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, jedoch nicht den Abschluss und unseren dazugehörigen Bericht des „Réviseur d'Entreprises Agréé“.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss umfasst nicht die anderen Informationen und wir geben hierzu kein Urteil mit Prüfungssicherheit ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Jahresabschlusses liegt es in unserer Verantwortlichkeit, die anderen Informationen zu lesen und dabei zu prüfen, ob die anderen Informationen dem Jahresabschluss oder unseren im Rahmen der Prüfung erlangten Erkenntnissen in wesentlicher Hinsicht widersprechen oder ansonsten wesentliche Falschaussagen zu enthalten scheinen. Wenn wir basierend auf der von uns durchgeführten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser anderen Informationen vorliegt, müssen wir über diese Tatsache berichten. Wir haben in dieser Hinsicht nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats der Gesellschaft bezüglich des Abschlusses

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft ist für die Erstellung und ehrliche Darstellung des Abschlusses gemäß den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen Luxemburgs für die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen und für entsprechenden internen Kontrollmaßnahmen verantwortlich, die der Verwaltungsrat der Gesellschaft für die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen für notwendig erachtet, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat der Gesellschaft verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit der Gesellschaft zur Fortsetzung des Geschäftsbetriebs. Dabei muss er Angelegenheiten, die sich auf die Fortsetzung des Geschäftsbetriebs und die Verwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung beziehen, gegebenenfalls offenlegen, es sei denn, der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat die Absicht, die Gesellschaft zu liquidieren oder die Geschäftstätigkeit einzustellen, bzw. hat keine realistische Alternative zu diesem Vorgehen.

Verantwortlichkeiten des „Réviseur d'Entreprises Agréé“ für die Prüfung des Jahresabschlusses

Das Ziel unserer Prüfung ist es, eine angemessene Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht des „Réviseur d'Entreprises Agréé“ zu erstellen, der unser Prüfungsurteil enthält. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, jedoch keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISA durchgeführte Prüfung alle eventuell bestehenden wesentlichen falschen Darstellungen aufdeckt. Unzutreffende Angaben können auf Betrug oder Irrtum zurückzuführen sein und gelten als wesentlich, wenn davon ausgegangen werden kann, dass sie jeweils einzeln oder in ihrer Gesamtheit die von den Verwendern dieser Jahresabschlüsse getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen beeinflussen können.

Im Rahmen unserer Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg angenommenen internationalen Prüfungsstandards nehmen wir eine fachliche Bewertung vor und wahren dabei ein professionelles Maß an Skepsis. Des Weiteren umfasst unsere Prüfung:

- Wir identifizieren und bewerten das Risiko, dass der Jahresabschluss aufgrund von Irrtum oder Betrug wesentliche unzutreffende Angaben enthält, entwerfen speziell auf diese Risiken zugeschnittene Prüfungsverfahren und wenden

diese an und erlangen Prüfungsnachweise, die eine hinreichende und angemessene Grundlage für unser Prüfungsurteil bilden. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen nicht entdeckt werden, ist höher als bei wesentlichen falschen Darstellungen, die aus Irrtümern resultieren, da dolose Handlungen geheime Absprachen, Fälschungen, gezielte Auslassungen, falsche Angaben wesentlicher Umstände oder die Umgehung interner Kontrollen beinhalten können.

- Die Erlangung eines Verständnisses der für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollen, um den Umständen angemessene Prüfungsverfahren zu erarbeiten, jedoch nicht, um eine Meinung über die Wirksamkeit der internen Kontrollen der Gesellschaft abzugeben.
- Die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und der vom Verwaltungsrat der Gesellschaft vorgenommenen Schätzungen und der damit in Zusammenhang stehenden Offenlegungen.
- Die Schlussfolgerung, ob der vom Verwaltungsrat der Gesellschaft bei der Erstellung des Abschlusses angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung angemessen ist und ob auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen besteht, die die Fähigkeit der Gesellschaft zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit ernsthaft in Zweifel stellen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Bericht des „*Reviseur d'Entreprises Agrée*“ auf die entsprechenden Offenlegungen im Abschluss hinzuweisen bzw. unser Prüfungsurteil zu ändern, falls die Offenlegungen unangemessen sind. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den bis zum Datum unseres Berichts des „*Reviseur d'Entreprises Agrée*“ erlangten Prüfungsnachweisen. Zukünftige Ereignisse oder Umstände können jedoch dazu führen, dass die Gesellschaft ihre Unternehmenstätigkeit nicht mehr fortführen kann.
- Die Beurteilung der Gesamtdarstellung und Struktur des Abschlusses sowie seines Inhalts einschließlich der Offenlegungen und der Frage, ob die Grundgeschäfte und Ereignisse im Abschluss so dargestellt sind, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild erreicht wird.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem in Bezug auf den geplanten Umfang und den Zeitplan für die Abschlussprüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich eventueller bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung entdecken.

Für Deloitte Audit, *Cabinet de révision agréé*

Yann Mérillou, *Réviseur d'entreprises agréé*

Partner

Luxemburg, 26. Oktober 2023

Nettovermögensaufstellung

per 30.06.2023

	Konsolidiert (in EUR)	JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (in USD)	JSS Sustainable Equity -Systematic Emerging Markets (in USD)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	4 666 062 495.14	385 275 429.18	39 172 824.12
Bankguthaben	120 634 387.03	5 104 772.83	1 313 013.69
Forderungen aus Devisengeschäften	2 212.52	-	-
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	16 494 628.98	72 790.79	-
Forderungen aus Finanzinstrumenten	185 077.45	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	259 958.55	-	-
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	29 312 915.03	4 678 682.72	137 007.82
Zinsforderungen aus Bankguthaben	36 666.93	1 865.12	458.56
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	30 791.70	33 593.75	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	8 261 354.94	856 787.51	0.01
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	229 160.85	-	-
Sonstige Forderungen	335 192.96	-	3 727.74
GESAMTAKTIVA	4 841 844 842.08	396 023 921.90	40 627 031.94
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	214 556.23	33 593.75	827.51
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	2 337.03	-	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	27 682 899.31	8 499 747.75	-
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	185 473.08	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	17 433 078.10	-	-
Swap-Zinsverbindlichkeiten	2 777.78	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	422 908.38	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	2 442 474.43	-	-
Sonstige Passiva	6 499 319.42	461 154.04	85 947.96
GESAMTPASSIVA	54 885 823.76	8 994 495.54	86 775.47
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	4 786 959 018.32	387 029 426.36	40 540 256.47

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2023

	JSS Sustainable Equity - Global Dividend (in USD)	JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) (in CHF)	JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) (in EUR)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	332 172 402.82	117 063 432.08	46 590 241.16
Bankguthaben	6 839 493.16	120 091.30	188 745.21
Forderungen aus Devisengeschäften	-	1 272.99	1.49
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	972 450.57	343 273.94
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	-	3 723.70	-
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	228 442.72	1 010 305.94	403 032.16
Zinsforderungen aus Bankguthaben	2 679.14	12.01	50.68
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	23 654.00	330 854.92	61 782.86
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swappeschäften	-	-	-
Sonstige Forderungen	67 531.82	18 211.51	4 596.67
GESAMTAKTIVA	339 334 203.66	119 520 355.02	47 591 724.17
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	-	59 504.30	22 440.38
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	-	-	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	-	405 550.27	78 892.04
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	1 630.84	2 716.56	3 380.38
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	-	-	-
Sonstige Passiva	329 327.17	212 590.67	87 751.69
GESAMTPASSIVA	330 958.01	680 361.80	192 464.49
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	339 003 245.65	118 839 993.22	47 399 259.68

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2023

	JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR) (in EUR)	JSS Twelve Sustainable Insurance Bond (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Global Thematic (in EUR)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	19 811 530.95	400 329 199.40	952 486 541.71
Bankguthaben	2 984.21	18 636 415.66	27 801 530.09
Forderungen aus Devisengeschäften	-	-	57.00
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	108 608.89	-	9 000 320.24
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	185 077.45	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	-	34 728.80	25 433.05
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	73 195.29	8 729 964.56	595 036.90
Zinsforderungen aus Bankguthaben	0.44	4 523.91	7 776.21
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	44 449.67	-	2 508 079.26
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Forderungen	3 702.27	-	64 017.94
GESAMTAKTIVA	20 044 471.72	427 919 909.78	992 488 792.40
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	6 130.93	204.90	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	337.19	9.42	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	33 208.84	-	9 111 032.64
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	185 473.08	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	-	19 906.00	260 924.74
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	-	2 196 759.20	-
Sonstige Passiva	53 297.35	365 416.24	1 538 364.56
GESAMTPASSIVA	92 974.31	2 767 768.84	10 910 321.94
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	19 951 497.41	425 152 140.94	981 578 470.46

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2023

	JSS Sustainable Bond - Global Short-term (in USD)	JSS Sustainable Bond CHF (in CHF)	JSS Sustainable Bond - Euro Broad (in EUR)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	260 597 516.66	20 398 727.86	115 641 156.69
Bankguthaben	2 075 915.19	513 637.14	3 279 672.33
Forderungen aus Devisengeschäften	11.90	-	-
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	147 319.82	287 453.55
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	-	-	-
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	3 294 786.26	94 398.36	745 027.79
Zinsforderungen aus Bankguthaben	522.07	53.81	664.31
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	528 413.88	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	-	-	31 388.15
Sonstige Forderungen	-	-	-
GESAMTAKTIVA	266 497 165.96	21 154 136.99	119 985 362.82
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	-	-	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	4 999 798.65	400 000.00	1 692 379.00
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	6 190.85	-	13 353.23
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	-	-	8 018.71
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	-	-	71 110.20
Sonstige Passiva	296 816.28	36 739.62	117 271.65
GESAMTPASSIVA	5 302 805.78	436 739.62	1 902 132.79
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	261 194 360.18	20 717 397.37	118 083 230.03

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2023

	JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Europe (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 (in EUR)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	84 793 672.52	37 578 327.06	87 170 838.27
Bankguthaben	1 739 145.99	235 333.26	806 258.86
Forderungen aus Devisengeschäften	-	-	-
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	-	-
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	12 328.44	111.55	2 363.02
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	824 820.75	21 605.31	85 892.99
Zinsforderungen aus Bankguthaben	442.96	59.44	264.99
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Forderungen	-	37 722.76	12 375.06
GESAMTAKTIVA	87 370 410.66	37 873 159.38	88 077 993.19
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	-	-	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	199 054.00	-	-
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	69 749.82	79 116.26	329.86
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	1 644.09	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	60 698.73	-	-
Sonstige Passiva	76 727.42	68 909.20	131 191.85
GESAMTPASSIVA	407 874.06	148 025.46	131 521.71
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	86 962 536.60	37 725 133.92	87 946 471.48

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2023

	JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	JSS Sustainable Equity - USA	JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities
	(in EUR)	(in USD)	(in EUR)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	28 785 661.96	179 067 772.86	188 682 999.95
Bankguthaben	1 562 414.48	2 019 925.17	7 040 355.72
Forderungen aus Devisengeschäften	-	-	-
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	-	-
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	652.61	333.27	426.70
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	78 829.65	122 258.80	986 098.19
Zinsforderungen aus Bankguthaben	419.27	806.85	1 913.33
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	14.56	-	179 186.31
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Forderungen	-	-	55 514.17
GESAMTAKTIVA	30 427 992.53	181 211 096.95	196 946 494.37
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	-	-	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	31 732.05	7 934.20	6 187.15
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	-	-	-
Sonstige Passiva	69 320.08	175 766.02	325 362.52
GESAMTPASSIVA	101 052.13	183 700.22	331 549.67
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	30 326 940.40	181 027 396.73	196 614 944.70

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2023

	JSS Sustainable Equity - Green Planet (in EUR)	JSS Bond - USD High Yield (in USD)	JSS Sustainable Bond - Total Return Global (in USD)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	347 019 700.27	179 936 185.70	412 915 056.28
Bankguthaben	6 766 128.12	5 053 412.34	12 349 644.42
Forderungen aus Devisengeschäften	-	-	-
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	3 095 951.41	-	948 005.76
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	76 957.94	-	48 970.61
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	558 678.55	3 139 654.70	3 666 186.14
Zinsforderungen aus Bankguthaben	1 355.74	1 918.14	4 689.08
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	-	4 022 710.38
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swappeschäften	-	-	215 770.02
Sonstige Forderungen	32 559.54	-	-
GESAMTAKTIVA	357 551 331.57	188 131 170.88	434 171 032.69
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	-	-	101 753.47
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	574.83	-	1 544.41
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	364 627.48	68 223.96	2 199 819.99
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	112 279.43	164 974.49	142 502.29
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-	-	3 030.56
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	-	-	442 882.18
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	8 110.63	115 377.44	-
Sonstige Passiva	580 644.91	316 587.67	393 444.36
GESAMTPASSIVA	1 066 237.28	665 163.56	3 284 977.26
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	356 485 094.29	187 466 007.32	430 886 055.43

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2023

	JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer (in USD)	JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors (in USD)	JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency (in USD)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	51 111 482.40	255 541 458.97	27 269 169.19
Bankguthaben	2 763 227.44	850 618.91	1 390 174.54
Forderungen aus Devisengeschäften	-	881.79	-
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	1 294 375.21	-
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	-	41 900.91	-
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	6 224.42	15 269.51	672 597.83
Zinsforderungen aus Bankguthaben	1 023.84	187.48	190.50
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	52 152.34	111 882.83
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Forderungen	-	44 437.09	-
GESAMTAKTIVA	53 881 958.10	257 841 282.21	29 444 014.89
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	-	-	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	-	1 010 243.72	-
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	916.90	243 393.02	8 188.44
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	-	-	7 968.75
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	-	-	-
Sonstige Passiva	58 383.19	385 078.53	42 918.97
GESAMTPASSIVA	59 300.09	1 638 715.27	59 076.16
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	53 822 658.01	256 202 566.94	29 384 938.73

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2023

JSS Equity - All China
(in USD)

AKTIVA

Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	294 966 920.54
Bankguthaben	16 891 213.50
Forderungen aus Devisengeschäften	33.47
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	425 190.34
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	21 322.50
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	490 009.11
Zinsforderungen aus Bankguthaben	6 528.10
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	-
Sonstige Forderungen	-
GESAMTAKTIVA	312 801 217.56

PASSIVA

Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	-
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	17 789 438.54
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Terminkontrakten	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	45.64
Sonstige Passiva	541 688.04
GESAMTPASSIVA	18 331 172.22

NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	294 470 045.34
--	-----------------------

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	Konsolidiert (in EUR)	JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (in USD)	JSS Sustainable Equity -Systematic Emerging Markets (in USD)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	5 147 446 105.53	429 637 909.62	40 073 747.66
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	38 800 012.93	-	837 583.51
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	79 460 143.20	17 093 991.89	-
Zinsen auf Bankguthaben	3 954 346.29	566 621.72	37 005.51
Zinserträge aus Swaps	34 568.49	-	-
Sonstige Erträge	364 360.89	5 646.38	0.26
Gesamterträge	122 613 431.80	17 666 259.99	874 589.28
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	51 071 664.26	3 063 817.42	482 517.85
Verwahrstellengebühr	654 826.75	55 334.60	17 607.30
Transaktionskosten	727 695.04	13 314.46	4 085.07
Zentralverwaltungsaufwand	8 217 358.78	771 232.43	76 531.65
Prüfungskosten	209 602.34	24 385.85	5 519.11
Kapitalsteuern	1 855 328.81	132 823.29	14 565.97
Gezahlte Zinsen für Bankverbindlichkeiten	320.55	-	-
Zinsaufwendungen aus Swaps	382 988.94	56 355.55	-
Sonstige Aufwendungen*	2 742 133.61	268 802.04	22 881.16
Gesamtaufwendungen	65 861 919.08	4 386 065.64	623 708.11
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	56 751 512.72	13 280 194.35	250 881.17
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen			
- aus Wertpapieren	-298 346 284.07	-43 026 257.05	-2 663 039.95
- aus Optionen/Warrants	3 415 443.93	-	-
- aus Swapgeschäften	4 925 049.80	-326 644.12	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-13 781 041.11	-1 568 768.48	-
- aus Devisenterminkontrakten	29 450 436.70	1 865 428.20	-18 647.56
- aus Devisen	3 833 986.80	268 189.82	-34 029.37
REALISIERTES ERGEBNIS	-213 750 895.23	-29 507 857.28	-2 464 835.71
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	393 433 755.84	38 162 745.06	1 058 289.98
- aus Optionen/Warrants	-1 124 902.17	-	-
- aus Swapgeschäften	-2 436 377.68	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	430 418.22	393 502.61	-
- aus Devisenterminkontrakten	-12 576 406.71	-285 806.69	635.32
ERGEBNIS	163 975 592.27	8 762 583.70	-1 405 910.41
Ausschüttungen	-20 675 649.78	-3 175 675.44	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-404 177 721.60	-48 195 391.52	1 872 419.22
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	-260 877 779.11	-42 608 483.26	466 508.81
Bewertungsdifferenz	-99 609 308.10	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	4 786 959 018.32	387 029 426.36	40 540 256.47

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	JSS Sustainable Equity - Global Dividend (in USD)	JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) (in CHF)	JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) (in EUR)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	224 130 435.42	142 854 450.67	57 003 550.85
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	7 618 530.01	720 108.56	266 207.43
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	-	1 668 617.48	621 071.81
Zinsen auf Bankguthaben	151 252.44	48 944.30	23 461.42
Zinserträge aus Swaps	-	-	-
Sonstige Erträge	192.92	27 040.95	8 230.73
Gesamterträge	7 769 975.37	2 464 711.29	918 971.39
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	2 311 377.19	1 976 051.08	696 311.08
Verwahrstellengebühr	22 366.17	26 626.41	16 497.79
Transaktionskosten	13 289.40	4 815.80	5 706.15
Zentralverwaltungsaufwand	534 971.79	266 325.75	103 253.57
Prüfungskosten	11 443.93	5 333.92	5 287.94
Kapitalsteuern	127 531.98	65 999.62	23 866.18
Gezahlte Zinsen für Bankverbindlichkeiten	-	-	-
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-	-
Sonstige Aufwendungen*	98 795.39	46 780.30	17 510.64
Gesamtaufwendungen	3 119 775.85	2 391 932.88	868 433.35
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	4 650 199.52	72 778.41	50 538.04
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertvermindierungen			
- aus Wertpapieren	-3 726 055.56	-9 224 264.38	-2 015 857.34
- aus Optionen/Warrants	624 075.59	-24 350.74	36 695.91
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	1 390.13	4 834 801.52	-157 375.11
- aus Devisen	15 248.58	-124 561.87	9 310.66
REALISIERTES ERGEBNIS	1 564 858.26	-4 465 597.06	-2 076 687.84
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	33 927 114.68	5 744 278.24	2 046 047.41
- aus Optionen/Warrants	104 766.84	-78 727.44	-55 701.10
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	23 654.00	-3 279 957.14	63 075.54
ERGEBNIS	35 620 393.78	-2 080 003.40	-23 265.99
Ausschüttungen	-871 329.85	-	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	80 123 746.30	-21 934 454.05	-9 581 025.18
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	114 872 810.23	-24 014 457.45	-9 604 291.17
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	339 003 245.65	118 839 993.22	47 399 259.68

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR) (in EUR)	JSS Twelve Sustainable Insurance Bond (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Global Thematic (in EUR)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	21 571 435.04	397 977 165.16	1 156 290 151.12
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	179 176.57	-	10 627 170.72
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	102 469.96	19 350 308.09	-
Zinsen auf Bankguthaben	4 946.35	301 002.18	535 918.16
Zinserträge aus Swaps	-	-	-
Sonstige Erträge	11 446.45	268.67	294 828.15
Gesamterträge	298 039.33	19 651 578.94	11 457 917.03
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	310 577.16	2 235 436.42	13 828 072.05
Verwahrstellengebühr	14 108.28	51 973.49	84 721.91
Transaktionskosten	4 465.54	2 107.33	1 532.25
Zentralverwaltungsaufwand	46 440.36	229 274.03	2 010 860.68
Prüfungskosten	5 242.27	8 827.17	25 990.83
Kapitalsteuern	9 806.84	73 747.99	364 745.06
Gezahlte Zinsen für Bankverbindlichkeiten	-	-	-
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-	-
Sonstige Aufwendungen*	8 820.03	423 349.72	404 798.83
Gesamtaufwendungen	399 460.48	3 024 716.15	16 720 721.61
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	-101 421.15	16 626 862.79	-5 262 804.58
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen			
- aus Wertpapieren	54 076.71	-10 099 117.58	-17 679 176.89
- aus Optionen/Warrants	15 836.92	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	13 198.35	4 426 157.38	11 189 335.31
- aus Devisen	2 828.94	4 514 050.24	-977 416.61
REALISIERTES ERGEBNIS	-15 480.23	15 467 952.83	-12 730 062.77
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	632 985.45	-5 088 442.60	102 524 189.79
- aus Optionen/Warrants	-25 312.42	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	47 161.47	-9 010 207.12	1 589 167.30
ERGEBNIS	639 354.27	1 369 303.11	91 383 294.32
Ausschüttungen	-	-1 947 027.90	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-2 259 291.90	27 752 700.57	-266 094 974.98
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	-1 619 937.63	27 174 975.78	-174 711 680.66
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	19 951 497.41	425 152 140.94	981 578 470.46

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	JSS Sustainable Bond - Global Short-term (in USD)	JSS Sustainable Bond CHF (in CHF)	JSS Sustainable Bond - Euro Broad (in EUR)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	281 935 395.94	20 299 481.47	126 716 636.64
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	-	-	-
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	10 958 973.69	220 915.70	2 078 091.62
Zinsen auf Bankguthaben	430 470.77	1 265.43	40 044.00
Zinserträge aus Swaps	-	-	6 222.22
Sonstige Erträge	2 779.92	-	69.84
Gesamterträge	11 392 224.38	222 181.13	2 124 427.68
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	1 986 122.81	127 055.77	714 288.49
Verwahrstellengebühr	37 658.08	10 017.07	22 924.38
Transaktionskosten	1 857.23	476.92	49 961.05
Zentralverwaltungsaufwand	523 901.60	45 032.93	23 132.25
Prüfungskosten	20 857.47	5 633.47	5 891.15
Kapitalsteuern	133 897.97	9 866.05	52 819.73
Gezahlte Zinsen für Bankverbindlichkeiten	-	-	-
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-	76 166.99
Sonstige Aufwendungen*	84 002.72	8 133.56	242 269.30
Gesamtaufwendungen	2 788 297.88	206 215.77	1 187 453.34
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	8 603 926.50	15 965.36	936 974.34
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen			
- aus Wertpapieren	-12 064 293.52	-93 111.21	-14 384 451.41
- aus Optionen/Warrants	-	-	2 477 310.00
- aus Swapgeschäften	-	-	4 851 548.35
- aus Terminkontrakten und CFD	-75 515.60	-	-5 324 969.30
- aus Devisenterminkontrakten	-516 400.63	-31.48	1 815 707.80
- aus Devisen	137 785.93	804.72	-17 042.44
REALISIERTES ERGEBNIS	-3 914 497.32	-76 372.61	-9 644 922.66
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	12 366 890.49	90 964.12	7 440 834.66
- aus Optionen/Warrants	-	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-2 251 326.01
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	529 671.29
- aus Devisenterminkontrakten	930 096.82	-	-1 544 253.58
ERGEBNIS	9 382 489.99	14 591.51	-5 469 996.30
Ausschüttungen	-4 007 119.59	-	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-26 116 406.16	403 324.39	-3 163 410.31
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	-20 741 035.76	417 915.90	-8 633 406.61
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	261 194 360.18	20 717 397.37	118 083 230.03

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (in EUR)	JSS Sustainable Green Bond - Global** (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Europe (in EUR)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	93 343 550.46	12 195 782.70	35 948 760.14
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	-	-	904 804.54
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	2 149 898.58	41 019.61	-
Zinsen auf Bankguthaben	45 010.13	-	4 249.72
Zinserträge aus Swaps	11 555.56	-	-
Sonstige Erträge	34.15	-	2.55
Gesamterträge	2 206 498.42	41 019.61	909 056.81
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	431 767.50	28 046.68	472 591.93
Verwahrstellengebühr	17 005.71	2 582.20	12 697.81
Transaktionskosten	4 638.29	435.35	2 560.75
Zentralverwaltungsaufwand	178 769.59	10 430.70	75 748.99
Prüfungskosten	5 943.90	1 624.33	5 272.87
Kapitalsteuern	40 152.70	1 597.37	17 994.12
Gezahlte Zinsen für Bankverbindlichkeiten	-	320.55	-
Zinsaufwendungen aus Swaps	154 222.21	-	-
Sonstige Aufwendungen*	29 533.34	2 013.67	15 262.43
Gesamtaufwendungen	862 033.24	47 050.85	602 128.90
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	1 344 465.18	-6 031.24	306 927.91
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen			
- aus Wertpapieren	-6 283 934.53	-3 807 140.58	76 894.07
- aus Optionen/Warrants	548 360.03	-	-
- aus Swapgeschäften	355 133.63	496 000.00	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-689 560.79	-193 070.00	-
- aus Devisenterminkontrakten	886 589.49	21 985.05	-
- aus Devisen	-2 528.94	116.43	-7 822.20
REALISIERTES ERGEBNIS	-3 841 475.93	-3 488 140.34	375 999.78
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	4 009 155.38	2 856 070.74	4 723 672.75
- aus Optionen/Warrants	-	-	-
- aus Swapgeschäften	-382 824.37	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	178 505.91	21 000.00	-
- aus Devisenterminkontrakten	-672 052.55	-13 083.53	-
ERGEBNIS	-708 691.56	-624 153.13	5 099 672.53
Ausschüttungen	-	-	-288 120.94
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-5 672 322.30	-11 571 629.57	-3 035 177.81
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	-6 381 013.86	-12 195 782.70	1 776 373.78
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	86 962 536.60	-	37 725 133.92

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

** Siehe Erläuterung 17

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Real Estate Global (in EUR)	JSS Sustainable Equity - USA (in USD)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	81 930 004.28	29 899 966.03	172 074 709.85
ERTRÄGE			
Nett dividendenerträge	938 639.07	920 460.81	1 356 676.38
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	-	-	-
Zinsen auf Bankguthaben	20 601.98	21 375.30	78 156.33
Zinserträge aus Swaps	-	-	-
Sonstige Erträge	1 454.73	25.08	1 557.62
Gesamterträge	960 695.78	941 861.19	1 436 390.33
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	1 127 354.15	427 444.70	1 340 774.39
Verwahrstellengebühr	11 089.85	15 505.58	15 618.41
Transaktionskosten	3 060.00	1 979.75	5 246.16
Zentralverwaltungsaufwand	167 774.62	66 431.44	322 216.36
Prüfungskosten	5 612.04	5 261.04	7 787.52
Kapitalsteuern	37 558.53	11 985.07	67 926.88
Gezahlte Zinsen für Bankverbindlichkeiten	-	-	-
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-	-
Sonstige Aufwendungen*	31 742.77	12 305.14	57 852.33
Gesamtaufwendungen	1 384 191.96	540 912.72	1 817 422.05
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	-423 496.18	400 948.47	-381 031.72
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen			
- aus Wertpapieren	1 641 714.29	-359 436.81	-977 679.50
- aus Optionen/Warrants	-	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	2 293.33	-1 243.57	180.92
- aus Devisen	-44 533.50	-46 968.19	2 712.71
REALISIERTES ERGEBNIS	1 175 977.94	-6 700.10	-1 355 817.59
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	9 302 740.08	-6 017 272.28	27 994 586.78
- aus Optionen/Warrants	-	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	-293.58	134.50	-
ERGEBNIS	10 478 424.44	-6 023 837.88	26 638 769.19
Ausschüttungen	-	-	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-4 461 957.24	6 450 812.25	-17 686 082.31
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	6 016 467.20	426 974.37	8 952 686.88
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	87 946 471.48	30 326 940.40	181 027 396.73

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Green Planet (in EUR)	JSS Bond - USD High Yield (in USD)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	195 931 861.18	290 610 424.64	213 643 463.27
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	1 479 793.57	4 509 240.96	150 796.51
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	2 744 355.28	-	12 661 178.33
Zinsen auf Bankguthaben	159 923.27	259 637.26	195 024.22
Zinserträge aus Swaps	-	-	-
Sonstige Erträge	9 478.55	-	4.25
Gesamterträge	4 393 550.67	4 768 878.22	13 007 003.31
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	2 688 172.43	4 855 047.92	2 668 196.31
Verwahrstellengebühr	29 544.27	41 056.07	16 492.01
Transaktionskosten	33 862.11	3 801.75	10 000.54
Zentralverwaltungsaufwand	92 722.24	641 559.85	389 534.99
Prüfungskosten	9 101.53	7 649.53	7 303.31
Kapitalsteuern	87 730.94	150 573.32	90 191.68
Gezahlte Zinsen für Bankverbindlichkeiten	-	-	-
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-	-
Sonstige Aufwendungen*	347 383.90	116 759.27	136 329.11
Gesamtaufwendungen	3 288 517.42	5 816 447.71	3 318 047.95
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	1 105 033.25	-1 047 569.49	9 688 955.36
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertvermindierungen			
- aus Wertpapieren	-530 730.31	-452 931.89	-8 745 404.84
- aus Optionen/Warrants	-161 282.04	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-6 420 543.07	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	-2 793 679.10	1 136 595.52	196 686.87
- aus Devisen	1 327 227.29	-349 828.47	-9 876.59
REALISIERTES ERGEBNIS	-7 473 973.98	-713 734.33	1 130 360.80
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	3 373 391.89	50 604 017.77	11 850 760.31
- aus Optionen/Warrants	-1 059 258.76	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	19 795.77	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	339 836.67	-667 793.18	-50 854.16
ERGEBNIS	-4 800 208.41	49 222 490.26	12 930 266.95
Ausschüttungen	-1 640 836.57	-	-6 313 610.31
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	7 124 128.50	16 652 179.39	-32 794 112.59
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	683 083.52	65 874 669.65	-26 177 455.95
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	196 614 944.70	356 485 094.29	187 466 007.32

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	JSS Sustainable Bond - Total Return Global (in USD)	JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer (in USD)	JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors (in USD)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	403 510 092.19	15 346 703.82	292 390 765.23
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	-	289 301.78	1 575 533.42
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	12 192 243.95	-	-
Zinsen auf Bankguthaben	504 294.63	52 887.25	88 994.90
Zinserträge aus Swaps	18 318.66	-	-
Sonstige Erträge	1 493.39	-	80.95
Gesamterträge	12 716 350.63	342 189.03	1 664 609.27
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	2 267 453.87	291 283.57	3 003 990.77
Verwahrstellengebühr	54 181.46	7 327.73	16 949.66
Transaktionskosten	70 623.64	124 336.36	396 124.13
Zentralverwaltungsaufwand	767 302.88	63 256.20	463 973.84
Prüfungskosten	9 239.92	5 852.82	5 828.22
Kapitalsteuern	155 681.30	16 463.32	98 786.56
Gezahlte Zinsen für Bankverbindlichkeiten	-	-	-
Zinsaufwendungen aus Swaps	110 130.77	-	-
Sonstige Aufwendungen*	121 871.23	57 494.16	89 118.65
Gesamtaufwendungen	3 556 485.07	566 014.16	4 074 771.83
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	9 159 865.56	-223 825.13	-2 410 162.56
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen			
- aus Wertpapieren	-27 125 023.71	-273 893.41	-21 257 820.79
- aus Optionen/Warrants	-52 968.70	-	-
- aus Swapgeschäften	-521 752.59	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	415 964.61	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	5 922 951.37	-442.36	157 528.75
- aus Devisen	-198 401.99	28 875.97	96 087.51
REALISIERTES ERGEBNIS	-12 399 365.45	-469 284.93	-23 414 367.09
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	28 312 408.58	7 095 587.76	74 659 649.93
- aus Optionen/Warrants	-	-	-
- aus Swapgeschäften	215 770.02	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-733 077.09	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	4 853.24	-	56 458.49
ERGEBNIS	15 400 589.30	6 626 302.83	51 301 741.33
Ausschüttungen	-3 181 470.27	-	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	15 156 844.21	31 849 651.36	-87 489 939.62
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	27 375 963.24	38 475 954.19	-36 188 198.29
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	430 886 055.43	53 822 658.01	256 202 566.94

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency (in USD)	JSS Equity - All China (in USD)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	34 180 664.57	491 033 374.30
ERTRÄGE		
Nettodividendenerträge	-	8 067 873.44
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	2 120 440.34	-
Zinsen auf Bankguthaben	32 498.74	575 821.86
Zinserträge aus Swaps	-	-
Sonstige Erträge	46.38	0.25
Gesamterträge	2 152 985.46	8 643 695.55
AUFWENDUNGEN		
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	295 608.06	5 310 998.19
Verwahrstellengebühr	13 325.59	67 795.81
Transaktionskosten	14 013.26	10 614.71
Zentralverwaltungsaufwand	11 337.53	714 635.65
Prüfungskosten	6 090.36	12 059.06
Kapitalsteuern	14 797.79	134 715.27
Gezahlte Zinsen für Bankverbindlichkeiten	-	-
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-
Sonstige Aufwendungen*	79 703.94	111 378.55
Gesamtaufwendungen	434 876.53	6 362 197.24
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	1 718 108.93	2 281 498.31
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen		
- aus Wertpapieren	-3 458 280.97	-133 023 956.11
- aus Optionen/Warrants	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-29 492.19	-
- aus Devisenterminkontrakten	1 101 545.24	-28 551.17
- aus Devisen	-121 879.49	-671 969.21
REALISIERTES ERGEBNIS	-789 998.48	-131 442 978.18
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung		
- aus Wertpapieren	3 005 884.16	-8 180 529.25
- aus Optionen/Warrants	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-7 968.75	-
- aus Devisenterminkontrakten	32 154.66	463.54
ERGEBNIS	2 240 071.59	-139 623 043.89
Ausschüttungen	-779 228.37	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-6 256 569.06	-56 940 285.07
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	-4 795 725.84	-196 563 328.96
Bewertungsdifferenz	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	29 384 938.73	294 470 045.34

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
Aa 4.75% 23-12.01.28	4.750	12.01.28	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Aac Techno 2.625% 21-02.06.26	2.625	02.06.26	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Abengoa 6.875% 30.04.43 /Pool Regs	6.875	30.04.43	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 327 064.06	0.34
Abq Finance 2.0% 21-06.07.26	2.000	06.07.26	USD	300 000	-	-	300 000	271 992.00	0.07
Abu Dhabi 3.0% 21-15.09.51 Regs	3.000	15.09.51	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Abu Dhabi N 4.696% 23-24.04.33	4.696	24.04.33	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Abu Dhabi P 2.50% 21-06.05.31	2.500	06.05.31	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Acwa Pwr 5.95% 17-15.12.39 Regs	5.950	15.12.39	USD	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Adcb Fin	4.500	06.03.23	USD	900 000	-	-900 000	-	-	0.00
Aeropuerto 4.0% 11.08.41 /P	4.000	11.08.41	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 201 788.30	0.31
Afrexbk 3.798% 21-17.05.31 Regs	3.798	17.05.31	USD	-	3 595 000	-	3 595 000	2 897 911.53	0.75
Afrexbk 5.25% 18-11.10.23	5.250	11.10.23	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 993 964.00	0.52
Africa Fina 3.125% 20-16.06.25	3.125	16.06.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 862 380.00	0.48
Africa Fina 4.375% 19-17.04.26	4.375	17.04.26	USD	2 200 000	-	-	2 200 000	2 047 650.00	0.53
Agr Bk Ch 1.25% 21-02.03.26	1.250	02.03.26	USD	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Aia Group 2.70% 21-Perp	2.700	31.12.99	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Aia Group 3.2% 15-11.03.25	3.200	11.03.25	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Aia Group 3.20% 20-16.09.40	3.200	16.09.40	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Aia Group 4.95% 23-04.04.33	4.950	04.04.33	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 500 864.75	0.39
Alfa Bk 5.95% 19-15.04.30	5.950	15.04.30	USD	500 000	-	-	500 000	30 000.00	0.01
Alibaba Grp 3.15% 21-09.02.51	3.150	09.02.51	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 294 135.64	0.33
Alibaba Grp 3.6% 15-28.11.24	3.600	28.11.24	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 937 828.94	0.50
Alibaba Grp 4.2% 17-06.12.47	4.200	06.12.47	USD	2 850 000	-	-	2 850 000	2 239 473.74	0.58
Alpek 4.25% 19-18.09.29 Regs	4.250	18.09.29	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 786 500.00	0.46
Amer Movil 3.625% 19-22.04.29	3.625	22.04.29	USD	3 000 000	2 000 000	-2 500 000	2 500 000	2 300 275.03	0.59
Amer Movil 4.375% 19-22.04.49	4.375	22.04.49	USD	1 700 000	-	-	1 700 000	1 475 697.41	0.38
Amer Movil 6.125% 10-30.03.40	6.125	30.03.40	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	2 127 831.80	0.55
Anglo Amer 4.75% 22-16.03.52	4.750	16.03.52	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	826 595.64	0.21
Anglo Amer 5.50% 02.05.33 Regs	5.500	02.05.33	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 959 825.18	0.51
Anglo Amer 5.625% 20-01.04.30	5.625	01.04.30	USD	-	5 000 000	-2 000 000	3 000 000	2 988 976.83	0.77
Antofagasta 5.625% 13.05.32 Regs	5.625	13.05.32	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 492 726.65	0.39
Arab Nat Bk 3.326% 20-28.10.30	3.326	28.10.30	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Arauco	4.500	01.08.24	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Arauco 4.25% 19-30.04.29	4.250	30.04.29	USD	800 000	2 000 000	-2 800 000	-	-	0.00
Arauco 5.15% 19-29.01.50	5.150	29.01.50	USD	800 000	1 500 000	-2 300 000	-	-	0.00
Arauco 5.50% 19-30.04.49	5.500	30.04.49	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Axiata Spv2 4.357% 16-24.03.26	4.357	24.03.26	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Axiata Spv5 3.064% 20-19.08.50	3.064	19.08.50	USD	2 800 000	-	-2 800 000	-	-	0.00
Axtel 6.375% 17-14.11.24	6.375	14.11.24	USD	170 000	200 000	-370 000	-	-	0.00
Baidu Inc 1.625% 21-23.02.27	1.625	23.02.27	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Banco 4.375% 11.04.27 Regs	4.375	11.04.27	USD	800 000	2 000 000	-800 000	2 000 000	1 891 877.00	0.49
Banco Con 5.25% 14-22.09.29 Regs	5.250	22.09.29	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Banco De 3.5% 17-12.10.27	3.500	12.10.27	USD	800 000	1 200 000	-	2 000 000	1 847 838.60	0.48
Banco Inbur 4.125% 14-06.06.24	4.125	06.06.24	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Banco Peru 3.25% 19-04.10.26 Regs	3.250	04.10.26	USD	1 400 000	1 100 000	-	2 500 000	2 327 860.30	0.60
Bancolumbia 3.0% 20-29.01.25	3.000	29.01.25	USD	1 650 000	-	-	1 650 000	1 568 706.32	0.41
Bangkok Bk	5.000	03.10.23	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Bangkok Bk 4.05% 18-19.03.24	4.050	19.03.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Bangkok Bk 4.45% 18-19.09.28 Regs	4.450	19.09.28	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Bank Mandiri 2.0% 21-19.04.26	2.000	19.04.26	USD	500 000	-	-	500 000	452 255.98	0.12
Bank Mandiri 4.75% 20-13.05.25	4.750	13.05.25	USD	700 000	-	-	700 000	686 817.29	0.18
Bank Mandiri 5.50% 23-04.04.26	5.500	04.04.26	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 499 777.72	0.39
Bank Philip 2.50% 19-10.09.24	2.500	10.09.24	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	962 075.00	0.25
Bank Rakyat 3.95% 19-28.03.24 Regs	3.950	28.03.24	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Bank Rakyat 4.625% 18-20.07.23	4.625	20.07.23	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Bbltb 3.733% 19-25.09.34	3.733	25.09.34	USD	200 000	1 300 000	-	1 500 000	1 273 351.80	0.33
Bbva Bancom 4.375% 14-10.04.24	4.375	10.04.24	USD	-	2 300 000	-2 300 000	-	-	0.00
Bea 4.0% 20-29.05.30	4.000	29.05.30	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Bermuda 3.375% 20-20.08.50	3.375	20.08.50	USD	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Bgaria 4.625% 22-23.09.34 Regs	4.625	23.09.34	EUR	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Bgaria-Flir 4.125% 22-23.09.29	4.125	23.09.29	EUR	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Bgaria-Flir 4.50% 23-27.01.33	4.500	27.01.33	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Bharat Petr	4.000	08.05.25	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	1 062 789.10	0.27
Bharti A 5.35% 14-20.05.24 Regs	5.350	20.05.24	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Bharti Airt 3.25% 21-03.06.31	3.250	03.06.31	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Bharti Airt 4.375% 15-10.06.25	4.375	10.06.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 944 457.66	0.50
Bk Hapoalim 3.255% 21-21.01.32	3.255	21.01.32	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 719 462.00	0.44
Bk Leumi 3.275% 20-29.01.31	3.275	29.01.31	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 688 420.00	0.69
Bk Of China	5.000	13.11.24	USD	1 350 000	1 500 000	-2 850 000	-	-	0.00
Bluest Fin 3.375% 19-16.07.24	3.375	16.07.24	USD	100 000	200 000	-300 000	-	-	0.00
Bnk Gosp K 5.375% 22.05.33 Regs	5.375	22.05.33	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 493 964.00	0.39
Bnk Gosp Kr 3.0% 22-30.05.29	3.000	30.05.29	EUR	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Boad 5% 17-27.07.27 Regs	5.000	27.07.27	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 289 800.00	0.59
Boc Aviat 2.625% 17.09.30 Regs	2.625	17.09.30	USD	1 200 000	-	-	1 200 000	1 023 784.45	0.26
Boc Aviat 3.5% 17-18.09.27	3.500	18.09.27	USD	2 300 000	-	-2 300 000	-	-	0.00
Boc Aviat 3.875% 16-27.04.26	3.875	27.04.26	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	948 781.07	0.25
Boc Aviatio 2.75% 20-02.12.23	2.750	02.12.23	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	986 110.00	0.25
Boc Aviatio 3% 19-11.09.29	3.000	11.09.29	USD	1 200 000	-	-	1 200 000	1 055 741.40	0.27
Boc Aviatio 4.875% 23-03.05.33	4.875	03.05.33	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	973 513.39	0.25
Bos Fund 4% 19-18.09.24 Regs	4.000	18.09.24	USD	3 150 000	-	-3 150 000	-	-	0.00
Bpri Intern 4.375% 17-18.01.27	4.375	18.01.27	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 910 139.64	0.49
Burgan Bank 2.75% 20-15.12.31	2.750	15.12.31	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Cable Onda 4.50% 19-30.01.30	4.500	30.01.30	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Cbq Finance 1.115% 18-17.10.22	1.115	17.10.22	CHF	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Celeo Rede 5.2% 22.06.47 /Pool	5.200	22.06.47	USD	500 000	-	-	500 000	427 774.20	0.11
Cemex 3.875% 21-11.07.31 Regs	3.875	11.07.31	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Cemex 5.45% 19-19.11.29	5.450	19.11.29	USD	1 000 000	1 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Cencosud 5.15% 15-12.02.25	5.150	12.02.25	USD	3 150 000	-	-	3 150 000	3 115 540.89	0.80
Cencosud 6.625% 15-12.02.45	6.625	12.02.45	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 498 935.00	0.39
Cerro 4.125% 17-16.08.27 Regs	4.125	16.08.27	USD	1 650 000	2 000 000	-1 650 000	2 000 000	1 869 706.40	0.48
Chile 3.5% 19-25.01.50	3.500	25.01.50	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
China 4.75% 18-08.02.28	4.750	08.02.28	USD	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
China Cinda 3.0% 20-18.03.27	3.000	18.03.27	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
China Cinda 3.0% 21-20.01.31	3.000	20.01.31	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
China Cinda 3.125% 20-18.03.30	3.125	18.03.30	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Cimb Bk 2.125% 22-20.07.27	2.125	20.07.27	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Ck Hutchiso 2.50% 08.05.30 Regs	2.500	08.05.30	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 597 652.42	0.67
Ck Hutchiso 4.75% 23-21.04.28	4.750	21.04.28	USD	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Ck Hutchiso 4.875% 23-21.04.33	4.875	21.04.33	USD	-	400 000	-	400 000	396 032.90	0.10
Cn Citic Bk 4.625% 19-28.02.29	4.625	28.02.29	USD	750 000	-	-750 000	-	-	0.00
Cn Const Hk 2.45% 20-24.06.30	2.450	24.06.30	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Cnac Hk Fin 4.125% 17-19.07.27	4.125	19.07.27	USD	2 050 000	-	-2 050 000	-	-	0.00
Coca Co F 1.85% 20-01.09.32	1.850	01.09.32	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Cofide 4.75% 15-15.07.25	4.750	15.07.25	USD	-	2 500 000	-	2 500 000	2 452 325.00	0.63
Colombia 3.875% 21-15.02.61	3.875	15.02.61	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 124 612.02	0.29
Colombia 4.125% 20-15.05.51	4.125	15.05.51	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Colombia 4.125% 21-22.02.42	4.125	22.02.42	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Colombia 7.50% 23-02.02.34	7.500	02.02.34	USD	-	1 250 000	-1 250 000	-	-	0.00
Colombia 8.0% 22-20.04.33	8.000	20.04.33	USD	-	6 149 000	-6 149 000	-	-	0.00
Colombia 8.125% 04-21.05.24	8.125	21.05.24	USD	4 000 000	-	-4 000 000	-	-	0.00
Compet Team 3.75% 19-12.03.24	3.750	12.03.24	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 967 140.00	0.51
Compet Team 4.25% 19-12.03.29	4.250	12.03.29	USD	500 000	-	-	500 000	468 901.41	0.12
Conadelco 3.70% 19-30.01.50	3.700	30.01.50	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Contemporar 1.875% 20-17.09.25	1.875	17.09.25	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Credito 2.7% 19-11.01.25 Regs	2.700	11.01.25	USD	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Credito 3.125% 20-01.07.30	3.125	01.07.30	USD	2 300 000	2 000 000	-2 300 000	2 000 000	1 837 403.32	0.47
Credito 3.25% 21-30.09.31	3.250	30.09.31	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Croatia 2.875% 22.04.32 Regs	2.875	22.04.32	EUR	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Dbs Group 3.30% 20-Perp	3.300	31.12.99	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 368 021.63	0.61
Dib Sukuk 2.95% 19-20.02.25	2.950	20.02.25	USD	2 150 000	-	-2 150 000	-	-	0.00
Dib Sukuk 2.95% 20-16.01.26	2.950	16.01.26	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Doha Fin 2.375% 21-31.03.26	2.375	31.03.26	USD	500 000	1 500 000	-2 000 000	-	-	0.00
Dp World	6.850	02.07.37	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 713 745.00	0.70
Ecopetrol 4.125% 14-16.01.25	4.125	16.01.25	USD	-	2 500 000	-	2 500 000	2 403 295.75	0.62
Ecopetrol 5.375% 15-26.06.26	5.375	26.06.26	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Ecopetrol 8.875% 23-13.01.33	8.875	13.01.33	USD	-	6 000 000	-4 000 000	2 000 000	1 982 268.22	0.51
Eibk 4.50% 22-15.09.32	4.500	15.09.32	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 970 756.02	0.51
Eibk 5.0% 23-11.01.28	5.000	11.01.28	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Eibk 5.125% 23-11.01.33	5.125	11.01.33	USD	-	600 000	-	600 000	615 542.82	0.16
Eig Pearl 3.545% 31.08.36 /Pool Regs	3.545	31.08.36	USD	1 700 000	1 300 000	-3 000 000	-	-	0.00
Emirate Frn 3.25% 17-14.11.22	3.250	14.11.22	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Emirate20 Frn 2.625% 18.02.25	2.625	18.02.25	USD	1 050 000	-	-	1 050 000	1 002 597.75	0.26
Empresa Nac 3.75% 16-05.08.26	3.750	05.08.26	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 845 804.65	0.74
Empresa Nac 6.15% 23-10.05.33	6.150	10.05.33	USD	-	200 000	-	200 000	199 173.00	0.05
Ena Master 4% 20-19.05.48 Pool Regs	4.000	19.05.49	USD	500 000	-	-	500 000	375 940.11	0.10
Eneris Chi 4.875% 18-12.06.28	4.875	12.06.28	USD	1 400 000	-	-	1 400 000	1 346 971.92	0.35
Entel 4.875% 13-30.10.24 /Pool	4.875	30.10.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Equate Petr 2.625% 21-28.04.28 Regs	2.625	28.04.28	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Equate Petr 4.25% 16-03.11.26	4.250	03.11.26	USD	2 300 000	-	-2 300 000	-	-	0.00
Equate Suku 3.944% 17-21.02.24	3.944	21.02.24	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Export Impo 3.902% 22-02.06.27	3.902	02.06.27	USD	2 200 000	-	-2 200 000	-	-	0.00
Expt-Imp In 3.25% 20-15.01.30	3.250	15.01.30	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Falabella 3.375% 21-15.01.32	3.375	15.01.32	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Far East Ho 2.625% 21-03.03.24	2.625	03.03.24	USD	1 650 000	-	-1 650 000	-	-	0.00
Fermaca 6.375% 30.03.38 /Pool	6.375	30.03.38	USD	1 583 000	-	-	1 583 000	1 170 738.42	0.30
Fgb Sukuk K 3.875% 19-22.01.24	3.875	22.01.24	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Fibria 4% 17-14.01.25	4.000	14.01.25	USD	-	1 800 000	-1 800 000	-	-	0.00
Fibria 5.5% 17-17.01.27	5.500	17.01.27	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 004 000.00	0.52
First 4.375% 23-24.04.28	4.375	24.04.28	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
First 5.125% 22-13.10.27	5.125	13.10.27	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Flex Ltd 4.875% 19-15.06.29	4.875	15.06.29	USD	1 150 000	-	-	1 150 000	1 095 983.64	0.28
Flex Ltd 4.875% 20-12.05.30	4.875	12.05.30	USD	1 400 000	-	-	1 400 000	1 354 517.56	0.35
Flextronics 4.75% 15-15.06.25	4.750	15.06.25	USD	200 000	-	-	200 000	195 323.47	0.05
Fnix 4.317% 17-20.09.27/PI Regs	4.317	20.09.27	USD	1 950 000	-	-1 950 000	-	-	0.00
Fomento Eco 3.50% 20-16.01.50	3.500	16.01.50	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Formosa	3.375	22.04.25	USD	1 500 000	-	-750 000	750 000	719 920.44	0.19
Foxcon 2.50% 20-28.10.30	2.500	28.10.30	USD	1 200 000	960 000	-	2 160 000	1 798 960.58	0.46
Fresnillo 4.25% 20-02.10.50	4.250	02.10.50	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 500 550.00	0.39
Gaci First 5.125% 23-14.02.53	5.125	14.02.53	USD	-	4 305 000	-4 305 000	-	-	0.00
Gaci First 5.0% 22-13.10.27	5.000	13.10.27	USD	-	3 500 000	-3 500 000	-	-	0.00
Gaci First 5.375% 22-13.10.22	5.375	13.10.22	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Galaxy 2.94% 30.09.40/Pool Regs	2.940	30.09.40	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 528 692.81	0.39
Galaxy 3.25% 20-30.09.40/Pool	3.250	30.09.40	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 553 407.50	0.40
Galaxy Pipe 1.75% 30.09.27 Regs	1.750	30.09.27	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Galaxy Pipe 2.625% 31.03.36Pool	2.625	31.03.36	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 023 734.38	0.52
Gaz Cap 5.15% 19-11.02.26 Regs	5.150	11.02.26	USD	2 630 000	-	-2 630 000	-	-	0.00
Gazprom 7.288% 07-16.08.37 Reg	7.288	16.08.37	USD	2 650 000	-	-2 650 000	-	-	0.00
Gazprom Pjs 3.0% 20-29.06.27	3.000	29.06.27	USD	3 600 000	-	-3 600 000	-	-	0.00
Gazprom Pjs 3.25% 20-25.02.30	3.250	25.02.30	USD	2 700 000	-	-2 700 000	-	-	0.00
Gbl Log 3.875% 15-04.06.25	3.875	04.06.25	USD	1 700 000	-	-1 700 000	-	-	0.00
Gc Treas C 2.98% 21-18.03.31	2.980	18.03.31	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	826 936.13	0.21
Gc Treas C 5.20% 22-30.03.52	5.200	30.03.52	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 558 983.89	0.66

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Geely Auto 4.0% 19-Perp	4.000	31.12.99	USD	1 900 000	-	-1 900 000	-	-	0.00
Geely Finan 3.0% 20-05.03.25	3.000	05.03.25	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Genm Capita 3.882% 21-19.04.31	3.882	19.04.31	USD	2 000 000	1 000 000	-2 000 000	1 000 000	809 560.95	0.21
Gf Orogen 6.125% 19-15.05.29	6.125	15.05.29	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Gnl Quinter 4.634% 14-29 /Pool	4.634	31.07.29	USD	1 000 000	1 500 000	-	2 500 000	1 860 873.12	0.48
Gohl Cap 4.25% 17-24.01.27 Regs	4.250	24.01.27	USD	3 800 000	1 000 000	-1 900 000	2 900 000	2 694 166.47	0.70
Greenko Pwr li 4.30% 13.12.28 /Pool	4.300	13.12.28	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Greensaif 6.129% 23.02.38 /Pool	6.129	23.02.38	USD	-	1 200 000	-	1 200 000	1 226 476.68	0.32
Grp Televis 6.125% 15-31.01.46	6.125	31.01.46	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 484 467.91	0.38
Grupo Bimbo 4% 19-06.09.49	4.000	06.09.49	USD	1 050 000	-	-1 050 000	-	-	0.00
Grupo Bimbo 5.95% 18-Perp	5.950	31.12.99	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Grupo Energ 4.875% 20-15.05.30 Regs	4.875	15.05.30	USD	-	2 500 000	-1 500 000	1 000 000	906 335.00	0.23
Gs-Caltex 1.625% 20-27.07.25	1.625	27.07.25	USD	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Gtl Trade F 7.25% 14-16.04.44	7.250	16.04.44	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 128 054.00	0.55
Hana Bank 4.375% 14-30.09.24	4.375	30.09.24	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Hindustan P 4% 17-12.07.27	4.000	12.07.27	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 877 450.00	0.49
Hk Land Fin 4.625% 14-16.01.24	4.625	16.01.24	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Hkt Capital	3.625	02.04.25	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 444 626.20	0.37
Hkt Capital 3.0% 22-18.01.32	3.000	18.01.32	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 267 882.50	0.33
Hong Kong 4.625% 23-11.01.33	4.625	11.01.33	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Hong Kong 5.25% 23-11.01.53	5.250	11.01.53	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Huarong 3.75% 19-29.05.24	3.750	29.05.24	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Huarong Fin	4.875	22.11.26	USD	1 700 000	-	-1 700 000	-	-	0.00
Huarong Fin 4.95% 17-07.11.47	4.950	07.11.47	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Hungary 5.75% 13-22.11.23	5.750	22.11.23	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Hungary 6.125% 23-22.05.28	6.125	22.05.28	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Hunt 6.375% 18-01.06.28 /Pool Regs	6.375	01.06.28	USD	-	2 900 000	-2 000 000	900 000	720 720.00	0.19
Hut Wha Int 7.45% 24.11.33 Regs	7.450	24.11.33	USD	500 000	-	-	500 000	592 386.55	0.15
Hyucap 3.75% 18-05.03.23 Regs	3.750	05.03.23	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Hyund Cap 1.65% 21-17.09.26	1.650	17.09.26	USD	-	1 600 000	-1 600 000	-	-	0.00
Hyund Cap 2.375% 20-15.10.27	2.375	15.10.27	USD	-	1 670 000	-	1 670 000	1 461 734.47	0.38
Hyund Cap 5.60% 23-30.03.28	5.600	30.03.28	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 492 619.60	0.39
Hyund Cap 5.80% 23-01.04.30 Regs	5.800	01.04.30	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 006 606.00	0.26
Hyundai Mtr 1.75% 21-06.05.26	1.750	06.05.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 767 694.14	0.46
Icbc 4.875% 15-21.09.25	4.875	21.09.25	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Icici Bk 3.8% 17-14.12.27 Regs	3.800	14.12.27	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 868 460.00	0.48
Icici Bk D 4% 16-18.03.26	4.000	18.03.26	USD	1 700 000	-	-	1 700 000	1 626 161.74	0.42
Ind Penoles 4.15% 19-12.09.29 Regs	4.150	12.09.29	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	2 780 232.60	0.72
Indian Rail 3.249% 20-13.02.30	3.249	13.02.30	USD	500 000	-	-	500 000	437 462.47	0.11
Indian Rail 3.73% 19-29.03.24	3.730	29.03.24	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Indian Rail 3.95% 20-13.02.50	3.950	13.02.50	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 527 093.80	0.39
Indofood 3.398% 21-09.06.31	3.398	09.06.31	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 538 807.00	0.66
Indofood 4.805% 21-27.04.52	4.805	27.04.52	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 117 402.19	0.29
Indonesia 3.70% 19-30.10.49	3.700	30.10.49	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Indonesia 4.20% 20-15.10.50	4.200	15.10.50	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 710 482.08	0.44
Indonesia 4.85% 23-11.01.33	4.850	11.01.33	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	997 625.97	0.26
Indonesia 5.45% 22-20.09.52	5.450	20.09.52	USD	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Indonesia 5.65% 23-11.01.53	5.650	11.01.53	USD	-	500 000	-	500 000	524 515.60	0.14
Indonesia A 5.45% 20-15.05.30	5.450	15.05.30	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Interchile 4.50% 21-30.06.56	4.500	30.06.56	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 247 107.50	0.32
Inver Cmpc 6.125% 23-23.06.33	6.125	23.06.33	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 013 627.20	0.52
Inversiones 4.75% 14-15.09.24	4.750	15.09.24	USD	2 000 000	1 000 000	-	3 000 000	2 960 280.00	0.76
Israel 4.50% 23-17.01.33	4.500	17.01.33	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Israel Chem 6.375% 18-31.05.38	6.375	31.05.38	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 022 816.00	0.52
Jd.Com 3.375% 20-14.01.30	3.375	14.01.30	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Jd.Com 4.125% 20-14.01.50	4.125	14.01.50	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Jsl Europe 5.20% 21-26.01.31	5.200	26.01.31	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Kazmunay 5.375% 18-24.04.30 Regs	5.375	24.04.30	USD	-	2 700 000	-	2 700 000	2 512 105.54	0.65
Kazmunay 6.375% 18-24.10.48 Regs	6.375	24.10.48	USD	-	1 809 000	-809 000	1 000 000	857 188.00	0.22

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Kazmunaygas 4.75% 19.04.27 Regs	4.750	19.04.27	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	950 655.00	0.25
Kazmunaygas 5.75% 19.04.47 Regs	5.750	19.04.47	USD	-	3 500 000	-	3 500 000	2 855 877.50	0.74
Kbank Hk 3.343% 19-02.10.31	3.343	02.10.31	USD	1 400 000	-	-1 400 000	-	-	0.00
Kmg Fin 3.50% 20-14.04.33	3.500	14.04.33	USD	-	2 500 000	-1 500 000	1 000 000	776 860.00	0.20
Korea Exch 4.25% 14-14.10.24	4.250	14.10.24	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Korea Gas 6.25% 12-20.01.42	6.250	20.01.42	USD	500 000	-	-	500 000	579 017.00	0.15
Koroil 4.875% 23-03.04.28	4.875	03.04.28	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Kyobo Life 5.90% 22-Perp	5.900	31.12.99	USD	2 000 000	1 140 000	-1 000 000	2 140 000	2 102 550.00	0.54
Lenovo Grp 3.421% 20-02.11.30	3.421	02.11.30	USD	2 500 000	2 500 000	-5 000 000	-	-	0.00
Lg Chem 3.625% 19-15.04.29	3.625	15.04.29	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Lima Me 5.875% 05.07.34 /Pool	5.875	05.07.34	USD	1 550 000	2 000 000	-1 550 000	2 000 000	893 329.59	0.23
Lima Metro 4.35% 19-05.04.36 Regs	4.350	05.04.36	USD	250 000	-	-	250 000	199 192.88	0.05
Llpl Cap 6.875% 19-04.02.39 /Pool	6.875	04.02.39	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Mashreqbk 7.875% 22-24.02.33	7.875	24.02.33	USD	-	1 300 000	-	1 300 000	1 360 223.80	0.35
Mauritius C 7.95% 23-26.04.28	7.950	26.04.28	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 066 940.00	0.53
Meglobal 5.875% 20-18.05.30 Regs	5.875	18.05.30	USD	1 450 000	-	-1 450 000	-	-	0.00
Meglobal Can Ulc 5% 20-18.05.25	5.000	18.05.25	USD	650 000	-	-650 000	-	-	0.00
Meituan Dnp 3.05% 20-28.10.30	3.050	28.10.30	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 585 052.82	0.41
Metalloinv 3.375% 21-22.10.28	3.375	22.10.28	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Mexico Airp 5.5% 17-31.07.47 Regs	5.500	31.07.47	USD	-	3 500 000	-2 000 000	1 500 000	1 312 134.75	0.34
Mexico Cete 3.771% 20-24.05.61	3.771	24.05.61	USD	1 500 000	1 000 000	-2 500 000	-	-	0.00
Mexico Cete 4.875% 22-19.05.33	4.875	19.05.33	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Mexico Cete 6.338% 23-04.05.53	6.338	04.05.53	USD	-	250 000	-	250 000	255 289.38	0.07
Mexico Cete 6.35% 23-09.02.35	6.350	09.02.35	USD	-	3 500 000	-1 500 000	2 000 000	2 107 582.80	0.54
Mfb Hd Bk 6.50% 23-29.06.28	6.500	29.06.28	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 983 484.00	0.51
Minejesa 5.625% 17-10.08.37 Regs	5.625	10.08.37	USD	3 300 000	-	-3 300 000	-	-	0.00
Misc Cap 3.75% 22-06.04.27 Regs	3.750	06.04.27	USD	1 500 000	1 500 000	-	3 000 000	2 808 740.40	0.73
Mivivi 4.265% 22-12.04.27 Regs	4.625	12.04.27	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 934 072.92	0.50
Mizrahi Tef 3.077% 21-07.04.31	3.077	07.04.31	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Morocco 3.0% 20-15.12.32 Regs	3.000	15.12.32	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Morocco 5.95% 23-08.03.28 Regs	5.950	08.03.28	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Muang Thai 3.552% 21-27.01.37	3.552	27.01.37	USD	-	1 950 000	-	1 950 000	1 690 609.93	0.44
Multibank 4.375% 17-09.11.22	4.375	09.11.22	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Myriad Intl 4.85% 17-06.07.27 Regs	4.850	06.07.27	USD	2 075 000	1 000 000	-	3 075 000	2 954 583.00	0.76
Nakilat 6.067% 06-31.12.33 Regs	6.067	31.12.33	USD	1 500 000	1 000 000	-	2 500 000	2 263 988.60	0.58
Nat Kazak 3.25% 18-05.12.23	3.250	05.12.23	CHF	800 000	-	-	800 000	872 967.44	0.23
Nbk Tier 1 4.50% 19-Perp Regs	4.500	31.12.99	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Nbm Us Hold 7% 19-14.05.26 Regs	7.000	14.05.26	USD	2 000 000	1 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Ocbc 1.832% 20-10.09.30	1.832	10.09.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	912 090.00	0.24
Ocbc 4.25% 14-19.06.24	4.250	19.06.24	USD	500 000	-	-	500 000	491 624.02	0.13
Office Cher 5.125% 21-23.06.51	5.125	23.06.51	USD	1 850 000	1 000 000	-1 850 000	1 000 000	731 240.00	0.19
Office Cher 6.875% 14-25.04.44	6.875	25.04.44	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	920 965.00	0.24
Ooredoo Int	3.750	22.06.26	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	971 906.00	0.25
Ooredoo Int 2.625% 21-08.04.31	2.625	08.04.31	USD	3 000 000	-	-2 000 000	1 000 000	863 498.00	0.22
Otp Bank 7.50% 23-25.05.27	7.500	25.05.27	USD	-	2 500 000	-	2 500 000	2 501 775.00	0.65
Panama 3.87% 19-23.07.60 /Pool	3.870	23.07.60	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Panama 4.50% 20-01.04.56 /Pool	4.500	01.04.56	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Panama 4.50% 22-19.01.63 /Pool	4.500	19.01.63	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Panama 6.40% 22-14.02.35	6.400	14.02.35	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 567 993.80	0.41
Panama 6.853% 23-28.03.54	6.853	28.03.54	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Paraguay 5% 16-15.04.26	5.000	15.04.26	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Pertamina 5.625% 20.05.43 Regs	5.625	20.05.43	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 929 513.20	0.50
Peru 2.78% 20-01.12.60	2.780	01.12.60	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Peru 7.35% 05-21.07.25	7.350	21.07.25	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Perus Gas	5.125	16.05.24	USD	2 200 000	-	-2 200 000	-	-	0.00
Philippine Gov 5.95% 13.10.47	5.950	13.10.47	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Philippine N 3.28% 19-27.09.24	3.280	27.09.24	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Phosagro Bd 3.05% 20-23.01.25	3.050	23.01.25	USD	1 150 000	-	-1 150 000	-	-	0.00
Pla Adm 4.962% 19-18.07.29 Regs	4.962	18.07.29	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	940 160.50	0.24

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Poland 4.875% 23-04.10.33	4.875	04.10.33	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Poland 5.50% 23-04.04.53	5.500	04.04.53	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Posco 2.50% 20-17.01.25 Regs	2.500	17.01.25	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Posco 2.75% 19-15.07.24	2.750	15.07.24	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Pow Fin 3.95% 20-23.04.30	3.950	23.04.30	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Prosus 3.061% 21-13.07.31 Regs	3.061	13.07.31	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 563 995.90	0.40
Prosus 3.68% 20-21.01.30	3.680	21.01.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	849 292.44	0.22
Prosus 3.832% 20-08.02.51 Regs	3.832	08.02.51	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	1 842 741.66	0.48
Prosus 4.027% 20-03.08.50 Regs	4.027	03.08.50	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 256 615.62	0.32
Prosus 4.193% 22-19.01.32	4.193	19.01.32	USD	-	3 100 000	-1 100 000	2 000 000	1 684 776.24	0.44
Prudential 2.95% 21-03.11.33	2.950	03.11.33	USD	-	5 000 000	-	5 000 000	4 227 975.00	1.09
Prudential 3.125% 20-14.04.30	3.125	14.04.30	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Prudential 3.125% 20-14.04.30	3.125	14.04.30	USD	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Pt Pertamina 6% 12-03.05.42 Regs	6.000	03.05.42	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 509 884.40	0.39
Pttep Treas 3.903% 19-06.12.59	3.903	06.12.59	USD	1 600 000	-	-900 000	700 000	504 517.29	0.13
Qatar 5.103% 18-23.04.48 Regs	5.103	23.04.48	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 996 732.00	0.52
Qatar Reins 4.95% 17-Perp Regs	4.950	31.12.99	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Qib Sukuk L 3.982% 19-26.03.24	3.982	26.03.24	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Qnb Fin 1.375% 21-26.01.26	1.375	26.01.26	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 813 800.00	0.47
Qnb Fin 2.75% 20-12.02.27	2.750	12.02.27	USD	700 000	-	-	700 000	647 270.40	0.17
Qnb Fin 3.5% 19-28.03.24	3.500	28.03.24	USD	1 500 000	1 500 000	-1 500 000	1 500 000	1 476 261.00	0.38
Qpetro 3.30% 21-12.07.51	3.300	12.07.51	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Qtel Int Fi 4.5% 13-31.01.43	4.500	31.01.43	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	959 725.00	0.25
Qtel Int Fi 5% 10-19.10.25 Reg-S	5.000	19.10.25	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Raiffeisenb 7.125% 23-19.01.26	7.125	19.01.26	EUR	-	1 700 000	-1 700 000	-	-	0.00
Raizn Fuel 5.3% 17-20.01.27 Regs	5.300	20.01.27	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Ras Laff 3 5.838% 30.09.27 /Pool	5.838	30.09.27	USD	500 000	3 960 000	-4 460 000	-	-	0.00
Rasga 6.332% 30.09.27 /Pool Regs	6.332	30.09.27	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Rec Ltd 5.25% 18-13.11.23	5.250	13.11.23	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	995 970.00	0.26
Reliance 3.625% 22-12.01.52 Regs	3.625	12.01.52	USD	-	1 870 000	-	1 870 000	1 334 570.90	0.34
Reliance In 2.875% 22-12.01.32	2.875	12.01.32	USD	-	3 500 000	-	3 500 000	2 919 773.50	0.75
Rh Int L 4.50% 18-27.03.28	4.500	27.03.28	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Riyad Bank 3.174% 20-25.02.30	3.174	25.02.30	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Rizal Commer Bk 3% 19-11.09.24	3.000	11.09.24	USD	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Romania 2.875% 14-28.10.24	2.875	28.10.24	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Romania 4.875% 14-22.01.24	4.875	22.01.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Romania 5.0% 22-27.09.26	5.000	27.09.26	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Romania 6.625% 22-27.09.29	6.625	27.09.29	EUR	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Romania 7.625% 23-17.01.53	7.625	17.01.53	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Rural Elec 3.50% 19-12.12.24	3.500	12.12.24	USD	850 000	-	-	850 000	817 389.35	0.21
Rural Elec 5.625% 23-11.04.28	5.625	11.04.28	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 978 869.90	0.51
Ruwais Pow 6% 13-31.08.36 /Pool	6.000	31.08.36	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 085 000.00	0.54
Sa Global S 0.946% 17.06.24 Regs	0.946	17.06.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Sabic 3.0% 20-14.09.50	3.000	14.09.50	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Sabic Ca 4.5% 18-10.10.28 Regs	4.500	10.10.28	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	979 953.00	0.25
Sabic Capit 4% 18-10.10.23	4.000	10.10.23	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Samba Fdg 2.75% 19-02.10.24	2.750	02.10.24	USD	700 000	1 300 000	-	2 000 000	1 928 650.00	0.50
Santander	4.125	09.11.22	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Santander 5.375% 20-17.04.25 Regs	5.375	17.04.25	USD	1 000 000	2 000 000	-	3 000 000	2 969 447.40	0.77
Santander 5.95% 18-1.10.28 Regs	5.950	01.10.28	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Saud Arabia 4.875% 23-18.07.33	4.875	18.07.33	USD	-	2 500 000	-1 000 000	1 500 000	1 500 321.00	0.39
Saud Arabia 5% 18-17.04.49 Regs	5.000	17.04.49	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Saudi Elec	4.000	08.04.24	USD	2 650 000	-	-2 650 000	-	-	0.00
Saudi Elec 4.632% 23-11.04.33	4.632	11.04.33	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Saudi Elec 4.723% 18-27.09.28	4.723	27.09.28	USD	1 700 000	-	-1 700 000	-	-	0.00
Saudi Elec 5.06% 08.04.43/Regs	5.060	08.04.43	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Saudi Elec 5.5% 14-08.04.44	5.500	08.04.44	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Saudi Oil 2.875% 19-16.04.24	2.875	16.04.24	USD	1 650 000	-	-1 650 000	-	-	0.00
Saudi Oil 3.25% 20-24.11.50 Regs	3.250	24.11.50	USD	1 650 000	-	-	1 650 000	1 148 152.50	0.30

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Saudi Oil 3.5% 19-16.04.29	3.500	16.04.29	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 384 320.00	0.36
Saudi Oil 3.50% 20-24.11.70	3.500	24.11.70	USD	2 250 000	-	-2 250 000	-	-	0.00
Saudi Oil 4.25% 19-16.04.39 Regs	4.250	16.04.39	USD	3 500 000	-	-1 500 000	2 000 000	1 767 780.00	0.46
Saudi Oil 4.375% 19-16.04.49 Regs	4.375	16.04.49	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Sb Capital 5.25% 13-23.05.23	5.250	23.05.23	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	30 000.00	0.01
Scotiabk Peru 4.5% (Fm) 13.12.27	4.500	13.12.27	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Serbia T-Bo 6.25% 23-26.05.28	6.250	26.05.28	USD	-	1 250 000	-	1 250 000	1 246 478.75	0.32
Serbia T-Bo 6.50% 23-26.09.33	6.500	26.09.33	USD	-	800 000	-	800 000	786 510.40	0.20
Shinhan 4.375% 22-13.04.32 Regs	4.375	13.04.32	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Shinhan Bk	3.875	24.03.26	USD	2 300 000	-	-	2 300 000	2 162 534.70	0.56
Shinhan Bk 4.50% 23-12.04.28	4.500	12.04.28	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Shinhan Fg 3.34% 19-05.02.30	3.340	05.02.30	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Shk Prop 3.75% 19-25.02.29	3.750	25.02.29	USD	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Shriram 4.40% 21-13.03.24	4.400	13.03.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Siam Commer 2.75% 17-16.05.23	2.750	16.05.23	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Sibur Sec L 2.95% 20-08.07.25	2.950	08.07.25	USD	3 150 000	-	-3 150 000	-	-	0.00
Sigma 4.125% 16-02.05.26	4.125	02.05.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 909 007.82	0.49
Singapore Tele. 7.375% 01-31	7.375	01.12.31	USD	500 000	-	-	500 000	587 535.75	0.15
Singtel Grp 2.375% 16-03.10.26	2.375	03.10.26	USD	300 000	-	-	300 000	273 298.76	0.07
Sk Brdband 4.875% 23-28.06.28	4.875	28.06.28	USD	-	500 000	-	500 000	493 054.97	0.13
Sk Hynix 1.50% 21-19.01.26	1.500	19.01.26	USD	200 000	-	-	200 000	177 214.32	0.05
Sk Hynix 6.50% 23-17.01.33	6.500	17.01.33	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 019 710.00	0.52
Sk On Co Lt 5.375% 23-11.05.26	5.375	11.05.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 984 102.20	0.51
Soquimich 3.50% 21-10.09.51	3.500	10.09.51	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
South Afr 4.85% 17-27.09.27	4.850	27.09.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
South Africa 4.665% 12-17.01.24	4.665	17.01.24	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 478 750.00	0.64
St Bk India 4.375% 24.01.24 Regs	4.375	24.01.24	USD	-	1 705 000	-	1 705 000	1 689 655.00	0.44
St Bk India 4.875% 23-05.05.28	4.875	05.05.28	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 961 422.38	0.51
St Marys 5.75% 16-28.01.27	5.750	28.01.27	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 005 228.00	0.52
Std Chart 3.516% 19-12.02.30	3.516	12.02.30	USD	-	4 275 000	-550 000	3 725 000	3 470 511.73	0.90
Std Chart 6.17% 23-09.01.27	6.170	09.01.27	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	999 291.82	0.26
Std Chart 7.767% 22-16.11.28	7.767	16.11.28	USD	-	4 000 000	-	4 000 000	4 247 392.40	1.10
Std Chart 7.776% 22-16.11.25	7.776	16.11.25	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 046 383.00	0.53
Summit Di 2.875% 12.08.31 Regs	2.875	12.08.31	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 581 857.50	0.41
Suzano Aust 2.50% 21-15.09.28	2.500	15.09.28	USD	-	500 000	-	500 000	426 209.60	0.11
Suzano Aust 3.125% 21-15.01.32	3.125	15.01.32	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Suzano Aust 3.75% 20-15.01.31	3.750	15.01.31	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Suzano Aust 5% 19-15.01.30	5.000	15.01.30	USD	2 300 000	-	-1 500 000	800 000	747 894.89	0.19
Swire Pac 3.875% 15-21.09.25	3.875	21.09.25	USD	1 700 000	-	-1 700 000	-	-	0.00
Tencent 3.29% 20-03.06.60 Regs	3.290	03.06.60	USD	400 000	1 600 000	-	2 000 000	1 239 915.94	0.32
Tencent Hl 4.525% 19-11.04.49 Regs	4.525	11.04.49	USD	850 000	-	-850 000	-	-	0.00
Tencent Hol 3.24% 20-03.06.50	3.240	03.06.50	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	984 054.84	0.25
Tencent Music 2% 20-03.09.30	2.000	03.09.30	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Thaioil 3.625% 18-23.01.23 Regs	3.625	23.01.23	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Thaioil Trs 3.50% 19-17.10.49	3.500	17.10.49	USD	1 550 000	-	-	1 550 000	988 302.74	0.26
Thaioil Trs 3.75% 20-18.06.50	3.750	18.06.50	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	668 532.24	0.17
Thaioil Trs 4.875% 18-23.01.43	4.875	23.01.43	USD	1 200 000	-	-	1 200 000	978 499.67	0.25
Thaioil Trs 5.375% -20.11.48	5.375	20.11.48	USD	1 350 000	-	-1 350 000	-	-	0.00
Tms Issuer 5.78% 23.08.32/Pool	5.780	23.08.32	USD	-	1 300 000	-	1 300 000	1 341 155.40	0.35
Tower B Inf 2.75% 21-20.01.26	2.750	20.01.26	USD	2 700 000	-	-	2 700 000	2 484 040.77	0.64
Tower B Inf 4.25% 20-21.01.25	4.250	21.01.25	USD	500 000	-	-	500 000	489 851.39	0.13
Trans Peru 4.25% 30.04.28 Regs	4.250	30.04.28	USD	2 500 000	-	-1 500 000	1 000 000	964 535.00	0.25
Transport 5.55% 18-01.11.28 Regs	5.550	01.11.28	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Trust 4.869% 20-15.01.30	4.869	15.01.30	USD	500 000	-	-	500 000	442 157.70	0.11
Trust F 5.25% 14-15.12.24 Regs	5.250	15.12.24	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 956 400.00	0.51
Tsmc Arizon 2.50% 21-25.10.31	2.500	25.10.31	USD	10 000 000	-	-6 000 000	4 000 000	3 354 233.28	0.87
Tsmc Arizon 4.25% 22-22.04.32	4.250	22.04.32	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Tsmc Arizon 4.50% 22-22.04.52	4.500	22.04.52	USD	4 000 000	-	-4 000 000	-	-	0.00
Tsmc Global 1.375% 20-28.09.30	1.375	28.09.30	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	2 354 009.97	0.61

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Tsmc Global 4.375% 22-22.07.27	4.375	22.07.27	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Tsmc Global 4.625% 22-22.07.32	4.625	22.07.32	USD	-	800 000	-800 000	-	-	0.00
Uobsp 1.75% 20-16.03.31	1.750	16.03.31	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	890 225.88	0.23
Uobsp 3.75% 19-15.04.29 Regs	3.750	15.04.29	USD	700 000	-	-	700 000	685 944.18	0.18
Uobsp 3.875% 17-Perp	3.875	31.12.99	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 482 723.77	0.38
Uruguay 4.975% 18-20.04.55 /Pool	4.975	20.04.55	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Uruguay 5.1% 14-18.06.50 /Pool	5.100	18.06.50	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Usa 3.625% 23-15.02.53 Tbo	3.625	15.02.53	USD	-	6 000 000	-6 000 000	-	-	0.00
Vietnam 4.8% 14-19.11.24	4.800	19.11.24	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 967 978.48	0.51
Vtb Cap 6.95% 12-17.10.22	6.950	17.10.22	USD	200 000	-	-	200 000	4 000.00	0.00
Weibo 3.375% 20-08.07.30	3.375	08.07.30	USD	2 000 000	1 500 000	-3 500 000	-	-	0.00
Woori Bk	4.750	30.04.24	USD	1 000 000	2 000 000	-	3 000 000	2 956 649.73	0.76
Woori Bk 4.875% 23-26.01.28	4.875	26.01.28	USD	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
								312 650 871.55	80.78

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind **312 650 871.55** **80.78**

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Abq Finance 1.875% 20-08.09.25	1.875	08.09.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	923 389.00	0.24
Abq Finance 3.125% 19-24.09.24	3.125	24.09.24	USD	1 300 000	1 000 000	-	2 300 000	2 225 505.30	0.58
Adcb 4.50% 22-14.09.27	4.500	14.09.27	USD	-	2 000 000	-1 000 000	1 000 000	985 670.00	0.25
Aldar Inves 4.875% 23-24.05.33	4.875	24.05.33	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 987 500.00	0.51
Anglo 4.75% 22-16.03.52 144A	4.750	16.03.52	USD	-	2 000 000	-1 000 000	1 000 000	826 595.64	0.21
Antofagasta 2.375% 20-14.10.30 Regs	2.375	14.10.30	USD	1 900 000	-	-1 900 000	-	-	0.00
Arauco 4.20% 19-29.01.30	4.200	29.01.30	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Banco Peru 3.375% 18-18.01.23	3.375	18.01.23	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Bancolumbia 4.625% 19-18.12.29	4.625	18.12.29	USD	100 000	200 000	-300 000	-	-	0.00
Banistmo 4.25% 20-31.07.27	4.250	31.07.27	USD	2 830 000	-	-2 830 000	-	-	0.00
Bbl Tb 9.025% 97-15.03.29	9.025	15.03.29	USD	-	2 500 000	-	2 500 000	2 791 997.75	0.72
Bco Dest Cl 2.704% 20-09.01.25	2.704	09.01.25	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Bdo Unibank 2.125% 20-13.01.26	2.125	13.01.26	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 759 411.82	0.71
Bea 4.875% 22-22.04.32	4.875	22.04.32	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Bk Leumi 5.125% 22-27.07.27	5.125	27.07.27	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	2 983 152.00	0.77
Boc Aviatio 1.625% 21-29.04.24	1.625	29.04.24	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	964 949.28	0.25
Boc Aviatio 1.75% 21-21.01.26	1.750	21.01.26	USD	500 000	-	-	500 000	451 560.01	0.12
Boc Aviatio 3.25% 20-29.04.25 Regs	3.250	29.04.25	USD	1 700 000	-	-	1 700 000	1 617 729.27	0.42
Bsf Financ 5.50% 23.11.27 Regs	5.500	23.11.27	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
China Overs 2.75% 20-02.03.30	2.750	02.03.30	USD	2 200 000	-	-2 200 000	-	-	0.00
Ck Hutchiso	2.750	03.10.26	USD	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Ck Hutchiso 2.75% 19-06.09.29	2.750	06.09.29	USD	950 000	-	-	950 000	837 781.38	0.22
Coca Co F 2.75% 20-22.01.30	2.750	22.01.30	USD	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Credito 2.875% 21-14.10.31	2.875	14.10.31	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 658 573.28	0.43
Dbs Group 1.822% 21-10.03.31	1.822	10.03.31	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 790 019.48	0.46
Dib Sukuk 1.959% 21-22.06.26	1.959	22.06.26	USD	1 800 000	-	-1 800 000	-	-	0.00
Eib Sukuk 2.082% 21-02.11.26	2.082	02.11.26	USD	750 000	-	-750 000	-	-	0.00
Elect Globa 4.10% 20-Perp	4.100	31.12.99	USD	1 400 000	-	-1 400 000	-	-	0.00
Empresa De 3.83% 21-14.09.61	3.830	14.09.61	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	2 046 943.14	0.53
Enn Energy 2.625% 20-17.09.30 Regs	2.625	17.09.30	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 255 070.91	0.32
Falabella 3.75% 17-30.10.27	3.750	30.10.27	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Far East Ho 3.375% 20-18.02.25	3.375	18.02.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Fel Energy 5.75% 01.12.40/Pool Regs	5.750	01.12.40	USD	1 800 000	-	-1 800 000	-	-	0.00
First 4.50% 20-Perp	4.500	31.12.99	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Gazprom Pjs 4.598% 20-Perp	4.598	31.12.99	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Geely Auto 3.625% 18-25.01.23	3.625	25.01.23	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Hcl America 1.375% 21-10.03.26	1.375	10.03.26	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Hdfc Bk 5.686% 23-02.03.26	5.686	02.03.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 996 246.74	0.52
Heungk 4.475% 09.11.47 Perp	4.475	31.12.99	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Huarong 3.375% 20-24.02.30	3.375	24.02.30	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Ibh Peru-B 3.875% 19-15.08.29	3.875	15.08.29	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Intcrp 4.125% 17-19.10.27 Regs	4.125	19.10.27	USD	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Inver Cmpc 3.85% 20-13.01.30	3.850	13.01.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	892 223.10	0.23
Israel Dis 5.375% 23-26.01.28	5.375	26.01.28	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 483 836.00	0.38
Kallpa 4.875% 16-24.05.26	4.875	24.05.26	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	963 255.00	0.25
Kdb 2.0% 21-25.10.31	2.000	25.10.31	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 635 279.54	0.42
Khazanah Ca 4.876% 23-01.06.33	4.876	01.06.33	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 981 371.44	0.51
Kookmin Bank 4.35% 19-Perp	4.350	31.12.99	USD	1 800 000	-	-1 800 000	-	-	0.00
Korea Gas 4.875% 23-05.07.28	4.875	05.07.28	USD	-	2 500 000	-	2 500 000	2 488 763.98	0.64
Korealife 4.70% 18-Perp	4.700	31.12.99	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Korearehabn 4.125% 22-20.04.27	4.125	20.04.27	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 834 688.00	0.73
Kt Corp 1.375% 21-21.01.27	1.375	21.01.27	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Li & F Ltd 4.50% 20-18.08.25	4.500	18.08.25	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Maf Glb Sec 7.875% 22-Perp	7.875	31.12.99	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 029 972.00	0.52
Maf Sukuk	4.500	03.11.25	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Majid Al Fu 5.0% 23-01.06.33	5.000	01.06.33	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	2 971 890.00	0.77
Millicom Ic 4.50% 20-27.04.31 Regs	4.500	27.04.31	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Mirae Asset 2.625% 20-30.07.25	2.625	30.07.25	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Nanyang Com 3.8% 19-20.11.29	3.800	20.11.29	USD	3 250 000	2 000 000	-3 250 000	2 000 000	1 910 958.90	0.49
Ocbc 4.602% 22-15.06.32	4.602	15.06.32	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 423 880.00	0.63
Pldt 2.50% 20-23.01.31	2.500	23.01.31	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 062 500.00	0.53
Pow Fin 4.50% 19-18.06.29	4.500	18.06.29	USD	1 650 000	-	-	1 650 000	1 532 421.00	0.40
Ptt Treasur 4.50% 19-25.10.42	4.500	25.10.42	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 110 304.43	0.55
Pttep Treas 2.993% 20-15.01.30	2.993	15.01.30	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 340 090.97	0.35
Qib Sukuk Frn 20-07.02.25	0.000	07.02.25	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 516 612.50	0.39
Rural Elec 2.25% 21-01.09.26	2.250	01.09.26	USD	900 000	1 800 000	-2 700 000	-	-	0.00
Saudi Elec 5.684% 23-11.04.53	5.684	11.04.53	USD	-	2 000 000	-1 000 000	1 000 000	993 640.00	0.26
Saudi Telec 3.89% 19-13.05.29	3.890	13.05.29	USD	1 450 000	-	-1 450 000	-	-	0.00
Sd Hi-Sp Gr 2.437% 20-19.11.23	2.437	19.11.23	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Sibur Sec L 3.45% 19-23.09.24	3.450	23.09.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Singtel Grp 1.875% 20-10.06.30	1.875	10.06.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	834 784.16	0.22
Sino-Ocean 4.75% 19-05.08.29	4.750	05.08.29	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Sinopec Gro 3.35% 20-13.05.50	3.350	13.05.50	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Sk Hynix 2.375% 21-19.01.31	2.375	19.01.31	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	771 622.92	0.20
Sk Telecom 6.625% 07-20.07.27	6.625	20.07.27	USD	800 000	-	-	800 000	845 426.40	0.22
Soquimich 4.25% 19-07.05.29 Regs	4.250	07.05.29	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Soquimich 4.25% 20-22.01.50	4.250	22.01.50	USD	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Std Chart 6.187% 23-06.07.27	6.187	06.07.27	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	3 001 944.30	0.78
Std Chart 6.296% 23-06.07.34	6.296	06.07.34	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	3 005 025.60	0.78
Sura 4.375% 17-11.04.27	4.375	11.04.27	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Tencent Hol 2.39% 20-03.06.30 Regs	2.390	03.06.30	USD	4 000 000	1 000 000	-2 000 000	3 000 000	2 492 248.95	0.64
Tfci 2.625% 20-15.08.25	2.625	15.08.25	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Tfci 3.25% 20-15.08.30	3.250	15.08.30	USD	1 350 000	-	-1 350 000	-	-	0.00
Transmanta 4.7% 19-16.04.34	4.700	16.04.34	USD	1 600 000	-	-	1 600 000	1 482 528.64	0.38

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Union 2.125% 20-22.10.25	2.125	22.10.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	917 194.80	0.24
Vivo Energy 5.125% 20-24.09.27	5.125	24.09.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
							72 624 557.63		18.77
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								72 624 557.63	18.77
SUMME WERTPAPIERBESTAND								385 275 429.18	99.55
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								5 104 772.83	1.32
Sonstige Passiven								-3 350 775.65	-0.87
GESAMTNETTOVERMÖGEN								387 029 426.36	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

3Sbio Inc			HKD	246 500	-	-36 500	210 000	210 894.44	0.52
Accton Technology Corp			TWD	-	22 000	-	22 000	246 525.22	0.61
Adani Green Energy Ltd			INR	-	7 000	-	7 000	80 713.65	0.20
Adani Tot Rgr			INR	-	4 000	-	4 000	31 918.30	0.08
Advantech Co Ltd			TWD	17 000	-	-	17 000	223 519.84	0.55
Airports Of Thailand Pcl			THB	-	86 000	-86 000	-	-	0.00
Airports Of Thailand Pcl			THB	-	86 000	-86 000	-	-	0.00
Alibaba Group Holding Ltd			HKD	90 400	27 900	-	118 300	1 225 778.13	3.02
Alibaba Healt Info Technology			HKD	186 000	165 000	-	351 000	210 959.52	0.52
A-Living Services Co Ltd -H- Shs			HKD	144 000	-	-144 000	-	-	0.00
Ambev Sa			BRL	74 000	-	-74 000	-	-	0.00
Ambev Sa Sadr			USD	66 000	-	-66 000	-	-	0.00
Amorepacific Corp			KRW	1 730	1 600	-1 730	1 600	118 525.44	0.29
Amorepacific Group			KRW	5 500	-	-5 500	-	-	0.00
Anglo American Platinum Ltd			ZAR	2 500	-	-	2 500	112 652.30	0.28
Apollo Hosp			INR	-	2 500	-	2 500	155 367.65	0.38
Asian Paints			INR	13 000	6 000	-	19 000	778 684.40	1.92
Asustek Computer Inc			TWD	19 000	-	-19 000	-	-	0.00
Axis Bank Ltd			INR	15 000	2 500	-	17 500	210 647.77	0.52
B3 Sa - Brasil Bolsa Balcao			BRL	-	69 900	-	69 900	211 699.78	0.52
Baidu Inc -A-/Adr			USD	1 400	-	-1 400	-	-	0.00
Baidu Rg-A			HKD	-	16 000	-16 000	-	-	0.00
Bajaj Finance Ltd			INR	-	1 940	-	1 940	169 338.17	0.42
Bajaj Finserv Ltd			INR	1 040	-	-1 040	-	-	0.00
Bajaj Finserv Rg			INR	-	10 400	-10 400	-	-	0.00
Banco Bradesco /Sadr			USD	27 005	-	-27 005	-	-	0.00
Banco Do Brasil Sa			BRL	31 000	-	-	31 000	317 454.63	0.78
Bco Bradesco Sa /Pref.			BRL	52 000	-	-	52 000	177 321.85	0.44
Beigene Ltd /Adr			USD	1 500	-	-1 500	-	-	0.00
Bid Corporation Limited			ZAR	-	8 900	-	8 900	194 709.80	0.48
Bidvest Group Ltd			ZAR	-	14 800	-	14 800	204 970.88	0.51
Byd Company Limited -H-			HKD	-	6 500	-	6 500	207 359.75	0.51
Byd Electronic Co Ltd			HKD	48 000	-	-48 000	-	-	0.00
Cansino Biologics Inc. -H- 144A			HKD	6 000	21 000	-27 000	-	-	0.00
Cathay Financial Holding			TWD	129 000	-	-	129 000	178 724.37	0.44
Chailease			TWD	35 280	-	-	35 280	231 085.13	0.57
Chang Hwa Commercial Bank			TWD	-	340 000	-	340 000	203 596.83	0.50
China			HKD	140 000	-	-140 000	-	-	0.00
China Citic Bk -H-			HKD	511 000	-	-511 000	-	-	0.00
China Development Fin. Hld Co			TWD	530 000	400 000	-530 000	400 000	159 255.68	0.39
China Everbright Intl Ltd			HKD	487 000	-	-	487 000	192 025.34	0.47
China Lesso Group Holdings Ltd			HKD	130 000	179 000	-	309 000	202 671.51	0.50
China Literature Ltd 144A /Regs			HKD	43 800	-	-	43 800	184 162.26	0.45
China Longyuan Power H			HKD	154 000	-	-154 000	-	-	0.00
China Medical System Holdings			HKD	120 000	-	-	120 000	195 390.31	0.48
China Oilfield Services -H-			HKD	260 000	-	-60 000	200 000	206 466.51	0.51
China Overseas Land+Investment			HKD	89 600	-	-	89 600	195 284.14	0.48
China Overseas Property Hld Ltd			HKD	330 000	-	-110 000	220 000	221 498.49	0.55
China Resources Land			HKD	-	55 000	-	55 000	233 008.56	0.57
China Suntien -H-			HKD	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
China Van Co Ltd H Cny1			HKD	-	684	-684	-	-	0.00
China Vanke -H-			HKD	112 300	48 000	-	160 300	215 189.14	0.53
Cia De Concessoes Rodoviaras			BRL	118 000	24 000	-	142 000	413 578.24	1.02
Cia Energ Minas Gerais /Pref			BRL	88 010	-	-1	88 009	234 617.86	0.58

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Cimb Group Holdings Bhd			MYR	183 000	-	-183 000	-	-	0.00
Cipla Ltd /Demat.			INR	16 300	15 900	-16 300	15 900	196 718.62	0.49
Citic Securities -H- Shares			HKD	-	125 500	-	125 500	227 406.65	0.56
Cj Cheiljedang Corp			KRW	610	-	-610	-	-	0.00
Clicks Grp			ZAR	14 200	-	-14 200	-	-	0.00
Cn Everbr Bk /H			HKD	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Cn Intl Cap /H			HKD	-	108 000	-	108 000	189 357.10	0.47
Colgate-Palmolive (India) Ltd			INR	10 500	-	-	10 500	216 068.36	0.53
Country Garden Holdings			HKD	-	800 000	-	800 000	162 314.83	0.40
Country Garden Services			HKD	102 000	-	-102 000	-	-	0.00
Coway Co Ltd			KRW	3 600	-	-	3 600	120 088.98	0.30
Cspc Pharmaceut – Shs			HKD	-	140 000	-	140 000	121 659.56	0.30
Ctbc Financial Holding Co Ltd			TWD	200 000	-	-	200 000	159 576.76	0.39
Dabur India Ltd/Dematerialised			INR	32 400	-	-	32 400	226 290.04	0.56
Daqo New Energy/Sadr			USD	3 700	-	-	3 700	146 890.00	0.36
Delta Electronic Industrial			TWD	-	20 000	-	20 000	221 224.12	0.55
Discovery Shs			ZAR	12 413	17 000	-15 000	14 413	111 276.57	0.27
Dongbu Insurance Co Ltd			KRW	4 400	-	-	4 400	249 134.16	0.61
East Buy Holding Limited 144A			HKD	-	30 000	-	30 000	97 618.59	0.24
Eclat Textile Co Ltd			TWD	11 000	-	-	11 000	176 417.41	0.44
Enn Energy Holdings			HKD	-	15 000	-15 000	-	-	0.00
Equatorial Energia			BRL	39 500	-	-39 500	-	-	0.00
Far East Horizon			HKD	308 000	-	-	308 000	243 676.42	0.60
Far East Horizon Ltd Npv			HKD	-	2 588	-2 588	-	-	0.00
Far Eastern Nc			TWD	265 000	-	-265 000	-	-	0.00
First Financial Holding Comp.			TWD	218 000	4 360	-222 360	-	-	0.00
Firstrand Ltd /New			ZAR	70 000	-	-	70 000	253 823.33	0.63
Fomento Eco.Mexicano Sab /Units			MXN	-	23 500	-	23 500	259 696.75	0.64
Fosun International Ltd			HKD	-	260 000	-	260 000	178 495.27	0.44
Fubon Financial Holding Co Ltd			TWD	96 000	4 800	-	100 800	196 778.37	0.49
Gcl Tech – Registered Shs			HKD	-	700 000	-	700 000	161 676.80	0.40
Genscript Biotech Corp			HKD	76 000	54 000	-76 000	54 000	121 276.74	0.30
Giant Manufacture Co Ltd			TWD	-	27 000	-	27 000	199 390.68	0.49
Greentwn /Reit			HKD	276 000	-	-276 000	-	-	0.00
Grupo Fin Banorte -O-			MXN	-	22 000	-	22 000	181 137.69	0.45
Guodian Nari Technology Co -A-			CNH	24 000	4 800	-	28 800	91 585.40	0.23
Hanwha Chemical Corp			KRW	16 000	8 774	-5 000	19 774	634 858.11	1.57
Hanwha Galleria Rg			KRW	-	19 256	-	19 256	22 171.42	0.05
Hap Seng Consolidated Bhd			MYR	-	60 000	-60 000	-	-	0.00
Havells India Ltd			INR	-	10 500	-	10 500	164 191.99	0.41
Hcl Technologies /Demat.			INR	-	14 900	-	14 900	215 768.55	0.53
Hindustan Unilever Ltd			INR	7 000	-	-	7 000	228 526.54	0.56
Hiwin Technologies			TWD	24 000	-	-24 000	-	-	0.00
Housing Devt Fin Corp			INR	-	17 500	-	17 500	601 992.48	1.49
Housing Devt. Fin. Corp /Adr			USD	3 000	-	-3 000	-	-	0.00
Hua Nan Financial Holding Co			TWD	269 000	159 146	-170 000	258 146	184 005.85	0.45
Huatai Securities Co Ltd			HKD	-	182 800	-	182 800	225 799.33	0.56
Hutchmed /Sadr Depo Shs Rep 5			USD	22 000	-	-22 000	-	-	0.00
Hygeia Healthc Rg			HKD	-	28 000	-	28 000	151 493.84	0.37
Hyundai Glovis Co Ltd			KRW	1 450	-	-1 450	-	-	0.00
Hz Tigermed C-H Rg			HKD	18 800	12 000	-	30 800	175 486.32	0.43
Icici			INR	-	11 600	-	11 600	190 110.61	0.47
Ihh Healthcare Bhd			MYR	137 000	-	-137 000	-	-	0.00
Impala Platinum Holdings Ltd			ZAR	-	23 000	-	23 000	152 577.73	0.38
Indus Towers Rg Registered Shs			INR	80 600	-	-	80 600	161 377.92	0.40
Info Edge India Ltd			INR	-	3 000	-	3 000	163 967.08	0.40
Infosys – Shs			INR	-	38 700	-	38 700	630 026.13	1.55
Infosys Sadr			USD	43 400	-	-43 400	-	-	0.00
Itau Holding /Pref			BRL	46 000	-	-46 000	-	-	0.00

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Jd Health Intl			HKD	28 700	-	-28 700	-	-	0.00
Jd.Com Rg-A			HKD	-	32 600	-	32 600	550 778.12	1.36
Jiangsu Expressway Co -H-			HKD	210 000	-	-210 000	-	-	0.00
Kingboard Laminates Hldgs Ltd			HKD	145 000	-	-	145 000	136 366.15	0.34
Kingdee Int Software Gr.Co Ltd			HKD	103 000	10 000	-	113 000	151 116.13	0.37
Klabin Riocell Sa			BRL	50 400	20 000	-	70 400	317 705.04	0.78
Kotak Mahind			INR	-	9 400	-	9 400	211 588.78	0.52
Kuایشou Tech Rg-B			HKD	-	28 000	-	28 000	191 332.44	0.47
Kuala Lumpur Kepong Bhd			MYR	-	36 000	-36 000	-	-	0.00
Kumba Iron Ore Ltd			ZAR	9 720	-	-2 720	7 000	163 980.98	0.40
Lenovo Group Ltd			HKD	202 000	-	-202 000	-	-	0.00
Lg Chem Ltd /Pfd Shs /I01			KRW	800	2 080	-350	2 530	675 935.04	1.67
Lg Chemical Ltd			KRW	300	1 220	-270	1 250	632 816.25	1.56
Lg Energy Solu Rg			KRW	-	350	-	350	146 904.45	0.36
Lg Household & Healthcare Pref			KRW	400	280	-680	-	-	0.00
Lg Innotek Co Ltd			KRW	760	-	-760	-	-	0.00
Li Auto Inc - A - Shs			HKD	-	15 000	-	15 000	259 359.20	0.64
Li Auto Inc /Sadr			USD	8 230	-	-8 230	-	-	0.00
Localiza Rent A Car			BRL	21 000	9 000	-	30 000	425 995.34	1.05
Lojas Renner Sa			BRL	-	50 000	-	50 000	207 297.00	0.51
Longfor Ppt			HKD	-	96 000	-	96 000	233 243.35	0.58
Ltimindtree Limited			INR	-	3 358	-	3 358	212 742.29	0.52
Media Tek Incorporation			TWD	18 000	-	-18 000	-	-	0.00
Meituan Dianping			HKD	26 700	26 110	-	52 810	824 164.15	2.03
Microport Scientific Corp			HKD	-	93 000	-	93 000	168 041.79	0.41
Micro-Star Intl			TWD	47 000	-	-47 000	-	-	0.00
Mindtree Ltd			INR	4 600	-	-4 600	-	-	0.00
Misc Bhd /Local			MYR	101 600	-	-101 600	-	-	0.00
Momentum Metropolitan Holdings			ZAR	29 768	-	-29 768	-	-	0.00
Momo.Com Inc			TWD	-	7 000	-	7 000	154 632.13	0.38
Mr. Price Group Limited			ZAR	15 700	-	-	15 700	119 841.66	0.30
Nan Ya Pcb			TWD	18 000	6 000	-	24 000	203 436.29	0.50
Nanya Technology Co Ltd			TWD	102 000	-	-102 000	-	-	0.00
Naspers Ltd -N-			ZAR	-	1 430	-	1 430	257 294.27	0.63
Ncsoft Corporation			KRW	-	560	-	560	125 386.80	0.31
Nedbank Group			ZAR	-	18 700	-	18 700	226 267.80	0.56
Nestle India /Dematerialised			INR	1 040	-	-	1 040	290 244.78	0.72
Nestle Malaysia Bhd			MYR	-	6 400	-6 400	-	-	0.00
Netease Rg			HKD	10 200	13 200	-8 400	15 000	292 090.13	0.72
Nien Made Enterprise Co Ltd			TWD	19 000	-	-	19 000	208 942.81	0.52
Nio Inc			USD	-	9 400	-9 400	-	-	0.00
Old Mutual Limited			ZAR	-	290 000	-	290 000	186 055.94	0.46
Phar Rg-H 144A-S			HKD	22 300	23 900	-	46 200	142 668.61	0.35
Pinduoduo Inc /Adr			USD	3 630	-	-3 630	-	-	0.00
Ping An Hlthcare Tech Co			HKD	78 300	-	-	78 300	189 239.95	0.47
Ping An Insur.(Grp) Co -H-			HKD	104 700	-	-10 000	94 700	602 401.77	1.49
President Chain Store Corp.			TWD	-	22 000	-	22 000	199 551.22	0.49
Public Bank - Shs			MYR	190 000	-	-190 000	-	-	0.00
Right Localiza Rent A 11.05.23			BRL	-	134	-134	-	-	0.00
Runtex Development Co Ltd			TWD	78 000	-	-78 000	-	-	0.00
Sabesp-Rg Shs			BRL	-	19 000	-	19 000	222 809.03	0.55
Samsung El./Sp.Gdr (1/2Vot144A)			USD	560	-	-560	-	-	0.00
Samsung Electr. /Pfd N-Vot.			KRW	9 600	-	-4 500	5 100	230 318.55	0.57
Samsung Electronics Co Ltd			KRW	36 000	-	-4 000	32 000	1 753 593.60	4.33
Samsung Fire&Marine Insur.			KRW	1 500	-	-	1 500	261 855.00	0.65
Samsung Sdi Co Ltd			KRW	-	350	-350	-	-	0.00
Sanlam Ltd			ZAR	65 000	-	-65 000	-	-	0.00
Santander Br /Units (55Sh+50Pfd)			BRL	33 000	-	-	33 000	209 533.73	0.52
Shanghai Fosun Pharma -H-			HKD	52 500	-	-52 500	-	-	0.00

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Shin Kong Financial Hld Co Ltd			TWD	660 000	-	-660 000	-	-	0.00
Shinhan Financial Group			KRW	-	5 000	-	5 000	129 030.00	0.32
Shriram Finance Limited			INR	-	11 000	-	11 000	232 672.97	0.57
Siam Cement Pub Co /Foreign			THB	38 400	-	-38 400	-	-	0.00
Siemens Ltd /Dematerialised			INR	7 000	-	-	7 000	321 391.18	0.79
Sinopac Holdings			TWD	-	300 000	-	300 000	167 122.14	0.41
Sk Biopharmac Rg			KRW	-	3 630	-	3 630	222 893.25	0.55
Sk Hynix Inc			KRW	6 550	-	-2 550	4 000	349 747.20	0.86
Taishin Financial Holdings			TWD	361 000	17 869	-378 869	-	-	0.00
Taiwan Semicond.Manufact			TWD	171 000	-	-29 000	142 000	2 626 177.54	6.48
Tata Consultancy Serv/Demat.			INR	6 800	3 200	-	10 000	402 544.28	0.99
Tata Elxsi Ltd			INR	-	2 500	-	2 500	231 259.54	0.57
Telefonica Brasil Sa			BRL	19 000	-	-19 000	-	-	0.00
Tencent Holdings Ltd			HKD	39 100	5 300	-	44 400	1 878 748.24	4.63
Tencent Mus			USD	-	23 000	-	23 000	169 740.00	0.42
Thai Oil Public Co /For. Reg.			THB	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
The Foschini Group			ZAR	-	45 200	-	45 200	224 958.08	0.56
Titan Com Shs			INR	6 500	-	-	6 500	241 480.55	0.60
Tongcheng Tra-Rg Shs S /144A			HKD	118 000	-	-118 000	-	-	0.00
Totvs Sa			BRL	32 600	-	-	32 600	202 601.31	0.50
Ultrapar Participacoes Sa			BRL	111 600	-	-	111 600	437 007.78	1.08
Unimicron Technology Corp			TWD	37 000	-	-	37 000	209 087.30	0.52
United Microelectr./Sadr			USD	27 000	-	-27 000	-	-	0.00
Vipshop Hldg Sp Adrepr 1/5Th			USD	-	18 500	-4 000	14 500	239 250.00	0.59
Voltron Pow			TWD	-	3 000	-	3 000	189 276.66	0.47
Wal-Mart De Mexico Sab Decv			MXN	55 000	-	-	55 000	217 170.25	0.54
Walsin Lihwa Corporation			TWD	-	112 000	-	112 000	147 439.94	0.36
Weg Sa			BRL	56 000	-	-10 000	46 000	359 971.24	0.89
Weichai Power Co Ltd /-H-			HKD	112 000	-	-	112 000	164 070.69	0.40
Weifu Hi-Tech Group Co Ltd -A-			CNH	20 000	-	-	20 000	43 364.30	0.11
Weimob Rg			HKD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Wharf Holdings Limited .The			HKD	90 000	-	-90 000	-	-	0.00
Woolworths Hld Ltd			ZAR	57 000	-	-57 000	-	-	0.00
Wuxi Apptec Co.. Ltd.			HKD	11 600	8 400	-	20 000	159 507.50	0.39
Wuxi Biologics Rg			HKD	32 100	12 000	-8 100	36 000	172 497.79	0.43
Xinjiang Goldwind -H-			HKD	166 000	120 000	-	286 000	195 979.85	0.48
Xpeng Inc /Adr			USD	6 000	6 000	-12 000	-	-	0.00
Yadea Group Holdings Ltd			HKD	140 000	-	-40 000	100 000	227 393.89	0.56
Yum China Holdings Inc			USD	-	3 630	-	3 630	205 095.00	0.51
Zhejiang Supor Cookware Co -A-			CNH	5 000	-	-	5 000	34 416.11	0.08
Zomat Rg 144A Reg S			INR	243 900	-	-	243 900	223 134.23	0.55
Zoomlion Heavy Shs H			HKD	427 000	-	-427 000	-	-	0.00
							38 778 088.37	95.65	

Optionen auf Wertpapiere

Rght Localiza Re 31.10.22 /Sous	31.10.22	BRL	-	64	-64	-	-	0.00
Right Hanwha Chem 09.01.23 /Sous	09.01.23	KRW	-	111	-111	-	-	0.00
Right Localiza Re 31.01.23 /Sous	31.01.23	BRL	-	91	-91	-	-	0.00
							-	0.00

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

38 778 088.37 95.65

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Aktien

Celltrion Pharm Inc		KRW	2 900	-	-2 900	-	-	0.00
---------------------	--	-----	-------	---	--------	---	---	------

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
E Ink Holdings Inc			TWD	-	30 000	-	30 000	216 729.00	0.54
Vanguard Intl.Semiconduct			TWD	59 000	63 000	-59 000	63 000	178 006.75	0.44
								394 735.75	0.98
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								394 735.75	0.98
Sonstige übertragbare Wertpapiere									
Anleihen									
Cathay Financial Rights	0.000	31.12.99	TWD	-	10 526	-10 526	-	-	0.00
Right Sinopac Holdings	0.000		TWD	-	15 798	-15 798	-	-	0.00
								-	0.00
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere								-	0.00
SUMME WERTPAPIERBESTAND								39 172 824.12	96.63
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								1 313 013.69	3.24
Sonstige Aktiven								54 418.66	0.13
GESAMTNETTOVERMÖGEN								40 540 256.47	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reverse Splits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Global Dividend

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

Allianz Se/Nam.Vinkuliert			EUR	16 805	10 221	-5 099	21 927	5 100 246.51	1.50
Amgen Inc			USD	28 510	20 325	-11 509	37 326	8 287 118.52	2.44
Asr Nederland Nv			EUR	82 376	55 766	-29 708	108 434	4 878 753.61	1.44
Axa			EUR	185 502	123 344	-66 229	242 617	7 153 386.35	2.11
Bristol Myers Squibb Co			USD	129 091	95 895	-51 495	173 491	11 094 749.45	3.27
Caterpillar Inc.			USD	40 518	41 177	-31 623	50 072	12 320 215.60	3.63
Cme Group Inc			USD	41 693	55 708	-29 595	67 806	12 563 773.74	3.71
Darden Restaurants			USD	64 564	48 684	-28 154	85 094	14 217 505.52	4.19
Deutsche Post Ag			EUR	62 111	38 306	-19 743	80 674	3 936 925.89	1.16
Deutsche Telekom /Nam.			EUR	207 795	141 756	-74 311	275 240	5 998 529.92	1.77
Emerson Electric Co.			USD	101 095	64 402	-34 316	131 181	11 857 450.59	3.50
Ferrovial Intl Rg			EUR	-	163 527	-	163 527	5 168 478.51	1.53
Ferrovial Sa			EUR	125 563	87 400	-212 963	-	-	0.00
Gilead Sciences Inc.			USD	-	76 197	-	76 197	5 872 502.79	1.73
Home Depot Inc.			USD	24 663	25 898	-10 234	40 327	12 527 179.28	3.70
Ibm			USD	44 741	59 309	-18 096	85 954	11 501 504.74	3.39
Inditex			EUR	119 138	170 008	-71 182	217 964	8 432 342.75	2.49
Johnson & Johnson			USD	43 290	37 096	-19 856	60 530	10 018 925.60	2.96
Keycorp			USD	401 312	258 364	-659 676	-	-	0.00
Koninklijke Ahold Delhaize N.V.			EUR	114 274	78 149	-41 339	151 084	5 152 668.45	1.52
Kuehne +Nagel International			CHF	6 563	14 565	-4 025	17 103	5 060 264.84	1.49
Mcdonald S Corp.			USD	32 477	32 548	-20 323	44 702	13 339 523.82	3.94
Merck			USD	77 039	50 257	-26 135	101 161	11 672 967.79	3.44
Michelin Sa Shs			EUR	116 888	71 977	-36 448	152 417	4 499 724.79	1.33
Nestle / Act Nom			CHF	30 270	21 813	-11 063	41 020	4 933 497.78	1.46
Nexity / -A-			EUR	72 981	39 660	-112 641	-	-	0.00
Novartis Ag Basel/Nam.			CHF	32 306	21 738	-11 827	42 217	4 246 947.45	1.25
Novo Nordisk A/S /-B-			DKK	34 106	23 011	-27 617	29 500	4 752 077.89	1.40
Paccar Inc.			USD	82 041	109 656	-32 379	159 318	13 326 950.70	3.93
Pepsico Inc			USD	55 883	37 398	-31 265	62 016	11 486 603.52	3.39
Pnc Financial Services Gp			USD	46 487	36 637	-18 309	64 815	8 163 449.25	2.41
Procter & Gamble Co.			USD	61 494	41 241	-22 836	79 899	12 123 874.26	3.58
Rockwell Automation			USD	25 392	15 928	-8 762	32 558	10 726 233.10	3.16
Royal Bank Of Canada			CAD	96 236	62 976	-34 025	125 187	11 969 512.37	3.53
Sanofi			EUR	31 893	21 724	-11 660	41 957	4 495 113.54	1.33
Schneider Electric Se			EUR	23 548	15 546	-8 383	30 711	5 577 358.99	1.65
Sodexo			EUR	43 864	29 031	-15 956	56 939	6 264 847.28	1.85
Te Connectivity /Reg Shs			USD	33 136	20 874	-11 119	42 891	6 011 602.56	1.77
Texas Instruments Inc			USD	55 328	37 885	-22 327	70 886	12 760 897.72	3.76
Total Sa			EUR	43 068	55 932	-10 976	88 024	5 046 596.37	1.49
Upm-Kymmene Corp			EUR	89 582	49 662	-24 083	115 161	3 426 220.55	1.01
Utd Parcel Service Inc B			USD	45 168	30 957	-17 042	59 083	10 590 627.75	3.12
Vodafone Group Plc			GBP	2 061 781	2 396 839	-1 087 974	3 370 646	3 169 814.81	0.94
Zurich Insurance Group /Nam			CHF	4 011	2 246	-1 108	5 149	2 445 437.87	0.72
							332 172 402.82		97.99

Indexoptionen

Caterpillar Inc.	19.05.23	USD	-	224	-224	-	-	0.00
Home Depot Inc.	16.12.22	USD	-	56	-56	-	-	0.00
Kuehne +Nagel International	15.07.22	CHF	-72	72	-	-	-	0.00

JSS Sustainable Equity - Global Dividend (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Te Connectivity /Reg Shs		21.10.22	USD	-	339	-339	-	-	0.00
Vodafone Group Plc		21.07.23	GBP	-	1 218	-1 218	-	-	0.00
								-	0.00
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								332 172 402.82	97.99
SUMME WERTPAPIERBESTAND								332 172 402.82	97.99
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								6 839 493.16	2.02
Sonstige Passiven								-8 650.33	-0.01
GESAMTNETTOVERMÖGEN								339 003 245.65	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in CHF	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Aia Group Ltd			HKD	265 000	9 200	-30 400	243 800	2 201 578.98	1.85
Air Liquide			EUR	14 536	257	-7 872	6 921	1 109 225.24	0.93
Alibaba Group Holding Ltd			HKD	71 940	-	-71 940	-	-	0.00
Alphabet Inc -A-			USD	-	32 216	-3 556	28 660	3 069 186.84	2.58
Alphabet Inc -C-			USD	1 424	29 727	-31 151	-	-	0.00
Amazon Com Inc			USD	28 520	975	-3 255	26 240	3 060 280.06	2.57
American Tower Corp			USD	4 477	-	-4 477	-	-	0.00
Amgen Inc			USD	10 743	980	-6 651	5 072	1 007 451.93	0.85
Aramark Holdings Corp			USD	33 418	14 334	-5 270	42 482	1 636 180.08	1.38
Asml Holding Nv			EUR	4 229	96	-1 716	2 609	1 688 361.14	1.42
Cme Group Inc			USD	8 955	4 013	-1 431	11 537	1 912 484.24	1.61
Colgate-Palmolive Co.			USD	13 157	4 431	-1 941	15 647	1 078 450.82	0.91
D S Smith Plc			GBP	335 400	42 024	-225 903	151 521	468 425.36	0.39
Daikin Industries Ltd			JPY	9 500	100	-6 300	3 300	597 781.50	0.50
Deere & Co.			USD	3 417	103	-725	2 795	1 013 196.13	0.85
Draper Esprit Plc			GBP	55 524	24 812	-80 336	-	-	0.00
Dsm-Firmenich Ltd			EUR	-	11 368	-1 254	10 114	973 566.65	0.82
Ecolab Inc.			USD	-	9 703	-943	8 760	1 463 113.95	1.23
Edwards Lifesciences			USD	15 617	6 033	-2 389	19 261	1 625 480.10	1.37
Entegris Inc			USD	-	15 075	-15 075	-	-	0.00
Equinix Inc /Reit			USD	2 159	73	-866	1 366	958 046.34	0.81
Equinor Asa			NOK	-	55 522	-6 129	49 393	1 287 300.57	1.08
Essilor International			EUR	9 841	184	-5 079	4 946	833 244.86	0.70
Housing Devt. Fin. Corp /Adr			USD	25 798	551	-11 527	14 822	924 256.64	0.78
Illumina Inc			USD	7 587	260	-865	6 982	1 171 145.74	0.99
Intl Flavors Frag			USD	12 123	6 960	-10 078	9 005	641 202.51	0.54
Inv Rg-B			SEK	75 050	-	-75 050	-	-	0.00
Koninklijke Dsm Nv			EUR	7 062	4 306	-11 368	-	-	0.00
Lse Group			GBP	16 434	455	-4 639	12 250	1 165 660.46	0.98
Mastercard Inc. Shs-A-			USD	8 162	179	-3 513	4 828	1 698 807.61	1.43
Medtronic Holdings Limited			USD	19 077	8 694	-3 066	24 705	1 947 214.33	1.64
Meituan			HKD	-	3 340	-3 340	-	-	0.00
Merck			USD	19 978	634	-3 543	17 069	1 762 094.69	1.48
Microsoft Corp			USD	11 355	1 083	-3 982	8 456	2 576 238.68	2.17
Middleby Corp			USD	9 660	270	-2 685	7 245	958 195.12	0.81
Msci Inc -A-			USD	3 610	-	-3 610	-	-	0.00
Otis Worldwide Corporation			USD	25 138	566	-10 485	15 219	1 211 931.04	1.02
Palo Alto Networks Inc			USD	-	7 043	-1 565	5 478	1 252 226.59	1.05
Paypal Holdings Inc			USD	17 556	600	-18 156	-	-	0.00
Reckitt Benckiser Group Plc			GBP	-	27 765	-3 065	24 700	1 660 922.99	1.40
Samsonite International			HKD	696 300	42 000	-210 000	528 300	1 332 898.16	1.12
Service Corp International			USD	-	19 643	-2 168	17 475	1 009 800.22	0.85
Servicenow Inc			USD	2 738	586	-626	2 698	1 356 463.36	1.14
Shiseido Co.Ltd			JPY	-	42 900	-4 600	38 300	1 539 303.22	1.30
Siemens Ag /Nam.			EUR	10 010	217	-4 409	5 818	866 233.95	0.73
Smith And Nephew Plc			GBP	91 105	-	-91 105	-	-	0.00
Splunk Inc			USD	11 503	3 281	-14 784	-	-	0.00
Svb Financial Group			USD	3 230	-	-3 230	-	-	0.00
Taiwan Semiconduct. Manuf/Sadr			USD	-	26 929	-2 732	24 197	2 184 699.74	1.84
Teleflex Inc			USD	5 494	-	-5 494	-	-	0.00
Tencent Holdings Ltd			HKD	28 200	14 300	-4 600	37 900	1 434 755.23	1.21
Tetra Tech Inc.			USD	-	5 430	-	5 430	795 440.33	0.67
Unilever Plc			EUR	-	14 126	-1 558	12 568	585 266.05	0.49

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in CHF	% des Netto- vermögens
Vonovia Se /Namen			EUR	29 127	-	-29 127	-	-	0.00
Walt Disney /Disney Ser			USD	18 744	641	-9 225	10 160	811 523.09	0.68
								54 869 634.54	46.17
Anleihen									
Allianz 2.625% 20-Perp	2.625	31.12.99	EUR	800 000	400 000	-	1 200 000	822 580.79	0.69
Alpha Train	2.064	30.06.25	EUR	800 000	-	-	800 000	731 894.80	0.62
Ascendas Re 0.75% 21-23.06.28	0.750	23.06.28	EUR	830 000	-	-	830 000	648 347.09	0.55
Austria 2.1% 17-20.09.17	2.100	20.09.17	EUR	200 000	-	-	200 000	144 062.18	0.12
Bco Sab 0.875% 19-22.07.25	0.875	22.07.25	EUR	200 000	-	-	200 000	181 108.64	0.15
Bnp Par 1.125% 20-15.01.32 Regs	1.125	15.01.32	EUR	600 000	700 000	-	1 300 000	1 080 708.38	0.91
Btps 1.65% 15-01.03.32 /Btp	1.650	01.03.32	EUR	1 020 000	-	-	1 020 000	835 291.00	0.70
Chile 0.83% 19-02.07.31	0.830	02.07.31	EUR	665 000	-	-	665 000	512 170.92	0.43
Comcast 0.75% 20-20.02.32	0.750	20.02.32	EUR	700 000	-	-	700 000	537 697.26	0.45
Cs Group 1% 19-24.06.27	1.000	24.06.27	EUR	580 000	-	-580 000	-	-	0.00
Deut Bk 1.375% 21-17.02.32	1.375	17.02.32	EUR	900 000	-	-900 000	-	-	0.00
Deutschland 0.0% 20-15.08.50	0.000	15.08.50	EUR	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Digital Dut 1.0% 20-15.01.32	1.000	15.01.32	EUR	171 000	-	-	171 000	118 057.31	0.10
Digital Int 0.625% 21-15.07.31	0.625	15.07.31	EUR	650 000	-	-650 000	-	-	0.00
Enel Fin 1.125% 19-17.10.34	1.125	17.10.34	EUR	300 000	700 000	-	1 000 000	705 606.50	0.59
Eu 0.0% 20-04.07.35	0.000	04.07.35	EUR	900 000	-	-	900 000	606 892.20	0.51
Eurofima 3% 06-15.05.26	3.000	15.05.26	CHF	-	900 000	-	900 000	930 375.00	0.78
Fidelity NI 1% 19-03.12.28	1.000	03.12.28	EUR	300 000	530 000	-	830 000	691 303.53	0.58
Fluxys	2.750	27.11.29	EUR	800 000	-	-	800 000	701 842.22	0.59
France 2.25% 13-25.05.24 /Oat	2.250	25.05.24	EUR	-	4 600 000	-600 000	4 000 000	3 861 558.03	3.25
France 2.75% 25.10.27 Oat Regs	2.750	25.10.27	EUR	2 050 000	1 100 000	-1 150 000	2 000 000	1 938 158.05	1.63
France 4% 04-25.04.55 Oat	4.000	25.04.55	EUR	-	3 250 000	-1 850 000	1 400 000	1 562 636.94	1.31
France 4.75% 04-25.04.35 Oat	4.750	25.04.35	EUR	1 180 000	-	-1 180 000	-	-	0.00
Germany	4.750	04.07.28	EUR	6 530 000	580 000	-3 755 000	3 355 000	3 612 155.26	3.04
Germany	5.500	04.01.31	EUR	1 930 000	2 800 000	-	4 730 000	5 579 813.39	4.70
Germany	4.750	04.07.34	EUR	4 225 000	-	-	4 225 000	5 045 202.59	4.25
Germany 2% 13-15.08.23	2.000	15.08.23	EUR	-	4 250 000	-3 715 000	535 000	521 430.65	0.44
Germany 4.25% 07-04.07.39	4.250	04.07.39	EUR	5 525 000	1 230 000	-4 025 000	2 730 000	3 273 116.45	2.75
Heathrow Fd	0.500	17.05.24	CHF	1 250 000	-	-	1 250 000	1 231 875.00	1.04
Iberdrola 1.825% 21-Perp	1.825	31.12.99	EUR	300 000	-	-	300 000	227 285.50	0.19
Illinois To 3% 14-19.05.34	3.000	19.05.34	EUR	400 000	-	-	400 000	364 220.16	0.31
Ing Groep 1.625% 17-26.09.29	1.625	26.09.29	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	923 279.87	0.78
Ireland 2.4% 14-15.05.30	2.400	15.05.30	EUR	-	1 730 000	-	1 730 000	1 649 834.53	1.39
Italy 5.25% 98-29 Btp	5.250	01.11.29	EUR	-	2 700 000	-	2 700 000	2 862 019.11	2.41
Kkr Group Fin 1.625% 22.05.29	1.625	22.05.29	EUR	980 000	-	-	980 000	809 252.46	0.68
Lloyds Bank 2.375% 20-09.04.26	2.375	09.04.26	EUR	994 000	-	-	994 000	924 905.50	0.78
Merck	1.875	15.10.26	EUR	500 000	-	-	500 000	461 103.05	0.39
Mexico Cete 1.125% 20-17.01.30	1.125	17.01.30	EUR	430 000	-	-	430 000	347 189.17	0.29
Ndaq 0.875% 20-13.02.30	0.875	13.02.30	EUR	790 000	-	-	790 000	624 773.79	0.53
Ny Life Gbl 0.25% 20-23.01.27	0.250	23.01.27	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Orange 1.75% 20-Perp	1.750	31.12.99	EUR	800 000	-	-	800 000	657 289.78	0.55
Orsted 1.50% 21-18.02.21	1.500	18.02.21	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	721 097.01	0.61
Orsted 1.75% 19-09.12.19	1.750	09.12.19	EUR	240 000	-	-	240 000	199 909.52	0.17
Phoenix Gr 4.375% 18-24.01.29	4.375	24.01.29	EUR	560 000	180 000	-	740 000	657 698.77	0.55
Portugal 4.1% 15-15.02.45	4.100	15.02.45	EUR	600 000	50 000	-	650 000	691 060.19	0.58
Rabobk Ny 0.875% 20-05.05.28	0.875	05.05.28	EUR	200 000	-	-	200 000	171 201.02	0.14
Rte	2.000	18.04.36	EUR	1 100 000	-	-	1 100 000	884 081.63	0.74
Selp Financ 0.875% 21-27.05.29	0.875	27.05.29	EUR	1 090 000	500 000	-	1 590 000	1 213 655.71	1.02
Spain 1.5% 17-30.04.27	1.500	30.04.27	EUR	500 000	470 000	-	970 000	887 466.00	0.75
Spain 5.9% 11-30.07.26	5.900	30.07.26	EUR	1 460 000	150 000	-	1 610 000	1 686 908.58	1.42
Sr-Bolig 0.01% 20-25.02.30	0.010	25.02.30	EUR	1 386 000	-	-	1 386 000	1 085 989.47	0.91
Sse 1.75% 20-16.04.30	1.750	16.04.30	EUR	550 000	450 000	-1 000 000	-	-	0.00
Sse 3.125% 20-Perp	3.125	31.12.99	EUR	667 000	-	-	667 000	592 140.68	0.50
Standard Frn 20-09.09.30	0.000	09.09.30	EUR	587 000	-	-	587 000	532 249.46	0.45

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in CHF	% des Netto- vermögens
Std Chart 3.885% 18-15.03.24	3.885	15.03.24	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Tennet 2% 18-05.06.34	2.000	05.06.34	EUR	600 000	-	-	600 000	506 153.41	0.43
Thames Wat 0.875% 22-31.01.28	0.875	31.01.28	EUR	270 000	730 000	-1 000 000	-	-	0.00
Thermo Fish 1.75% 20-15.04.27	1.750	15.04.27	EUR	197 000	-	-	197 000	179 046.16	0.15
Verbund 0.90% 21-01.04.41	0.900	01.04.41	EUR	400 000	-	-	400 000	268 940.43	0.23
Verizon Com 1.50% 19-19.09.39	1.500	19.09.39	EUR	800 000	500 000	-	1 300 000	871 019.50	0.73
Virgin Mney 2.875% 20-24.06.25	2.875	24.06.25	EUR	1 520 000	-	-	1 520 000	1 437 825.13	1.21
York Build 0.625% 20-21.09.25	0.625	21.09.25	EUR	625 000	-	-	625 000	564 002.62	0.47
								58 875 482.39	49.54

Optionsscheine

Wt Carbon Perp Cert		31.12.99	GBP	79 520	25 130	-80 828	23 822	682 263.38	0.57
								682 263.38	0.57

Indexoptionen

Euro Stoxx 50 Pr		15.09.23	EUR	-	47	-	47	27 433.22	0.02
Euro Stoxx 50 Pr		15.09.23	EUR	-	-	-47	-47	-4 266.37	0.00
Msci Worl Net Index - M1wo		19.06.23	USD	-	130	-130	-	-	0.00
Msci Worl Net Index - M1wo		19.06.23	USD	-	130	-130	-	-	0.00
Msci Worl Net Index - M1wo		19.12.22	USD	-	53	-53	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.09.23	USD	-	-	-5	-5	-2 415.55	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.12.23	USD	-	-	-15	-15	-59 610.51	-0.05
Spx - S&P 500 Indices		15.09.23	USD	-	5	-	5	8 047.37	0.01
Spx - S&P 500 Indices		15.12.23	USD	-	15	-	15	108 686.51	0.09
								77 874.67	0.07

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

114 505 254.98 96.35

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Spain 3.45% 16-30.07.66	3.450	30.07.66	EUR	530 000	270 000	-	800 000	710 136.41	0.60
								710 136.41	0.60

Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere

710 136.41 0.60

Sonstige übertragbare Wertpapiere

Anleihen

Intl Fin 4.25% 20-16.07.25	4.250	16.07.25	BRL	1 800 000	-	-1 800 000	-	-	0.00
									0.00

Anlagefonds

Quaer C Argon -B- Eur/Cap			EUR	8 005	-	-1 796	6 209	1 848 040.69	1.56
								1 848 040.69	1.56

Summe sonstige übertragbare Wertpapiere

1 848 040.69 1.56

SUMME WERTPAPIERBESTAND

117 063 432.08 98.51

Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen

120 091.30 0.10

Sonstige Aktiven

1 656 469.84 1.39

GESAMTNETTOVERMÖGEN

118 839 993.22 100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Aia Group Ltd			HKD	104 200	2 400	-11 000	95 600	884 465.14	1.87
Air Liquide			EUR	5 772	68	-3 124	2 716	445 967.20	0.94
Alibaba Group Holding Ltd			HKD	28 100	-	-28 100	-	-	0.00
Alphabet Inc -A-			USD	-	11 644	-533	11 111	1 219 052.89	2.57
Alphabet Inc -C-			USD	580	11 286	-11 866	-	-	0.00
Amazon Com Inc			USD	11 780	261	-1 805	10 236	1 223 065.96	2.58
American Tower Corp			USD	1 860	-	-1 860	-	-	0.00
Amgen Inc			USD	4 377	332	-2 722	1 987	404 357.23	0.85
Aramark Holdings Corp			USD	13 437	4 799	-1 578	16 658	657 311.55	1.39
Asml Holding Nv			EUR	1 727	25	-731	1 021	676 923.00	1.43
Cme Group Inc			USD	3 646	1 446	-626	4 466	758 483.17	1.60
Colgate-Palmolive Co.			USD	5 448	1 515	-847	6 116	431 875.93	0.91
D S Smith Plc			GBP	131 439	15 896	-88 011	59 324	187 897.17	0.40
Daikin Industries Ltd			JPY	3 600	100	-2 400	1 300	241 264.90	0.51
Deere & Co.			USD	1 391	27	-322	1 096	407 046.97	0.86
Draper Esprit Plc			GBP	22 840	8 461	-31 301	-	-	0.00
Dsm-Firmenich Ltd			EUR	-	4 041	-46	3 995	393 986.90	0.83
Ecolab Inc.			USD	-	3 479	-34	3 445	589 502.34	1.24
Edwards Lifesciences			USD	6 389	1 904	-743	7 550	652 787.81	1.38
Entegris Inc			USD	-	5 585	-5 585	-	-	0.00
Equinix Inc /Reit			USD	856	19	-340	535	384 425.21	0.81
Equinor Asa			NOK	-	20 021	-681	19 340	516 408.38	1.09
Essilor International			EUR	3 867	48	-1 975	1 940	334 844.00	0.71
Housing Devt. Fin. Corp /Adr			USD	10 379	148	-4 723	5 804	370 796.33	0.78
Illumina Inc			USD	3 000	69	-338	2 731	469 326.48	0.99
Intl Flavors Frag			USD	4 959	2 562	-4 006	3 515	256 424.24	0.54
Inv Rg-B			SEK	29 203	-	-29 203	-	-	0.00
Koninklijke Dsm Nv			EUR	2 804	1 459	-4 263	-	-	0.00
Lse Group			GBP	6 702	118	-2 162	4 658	454 106.50	0.96
Mastercard Inc. Shs-A-			USD	3 354	47	-1 509	1 892	682 056.46	1.44
Medtronic Holdings Limited			USD	7 805	2 864	-1 131	9 538	770 208.80	1.62
Meituan			HKD	-	1 210	-1 210	-	-	0.00
Merck			USD	8 173	170	-1 665	6 678	706 301.03	1.49
Microsoft Corp			USD	4 623	358	-1 667	3 314	1 034 417.56	2.18
Middleby Corp			USD	3 795	71	-1 026	2 840	384 818.70	0.81
Msci Inc -A-			USD	1 483	-	-1 483	-	-	0.00
Otis Worldwide Corporation			USD	10 234	153	-4 418	5 969	486 985.05	1.03
Palo Alto Networks Inc			USD	-	2 547	-411	2 136	500 246.89	1.06
Paypal Holdings Inc			USD	7 143	166	-7 309	-	-	0.00
Reckitt Benckiser Group Plc			GBP	-	10 004	-320	9 684	667 159.36	1.41
Samsonite International			HKD	269 700	20 700	-83 700	206 700	534 292.52	1.13
Service Corp International			USD	-	6 985	-80	6 905	408 793.72	0.86
Servicenow Inc			USD	1 136	151	-229	1 058	544 971.82	1.15
Shiseido Co.Ltd			JPY	-	15 400	-400	15 000	617 644.99	1.30
Siemens Ag /Nam.			EUR	3 934	57	-1 711	2 280	347 791.20	0.73
Smith And Nephew Plc			GBP	37 554	-	-37 554	-	-	0.00
Splunk Inc			USD	4 682	1 083	-5 765	-	-	0.00
Svb Financial Group			USD	1 270	-	-1 270	-	-	0.00
Taiwan Semiconduct. Manuf/Sadr			USD	-	9 503	-109	9 394	868 966.53	1.83
Teleflex Inc			USD	2 167	-	-2 167	-	-	0.00
Tencent Holdings Ltd			HKD	11 200	4 900	-1 300	14 800	574 014.13	1.21
Tetra Tech Inc.			USD	-	2 076	-	2 076	311 571.26	0.66
Unilever Plc			EUR	-	4 908	-57	4 851	231 441.21	0.49

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Vonovia Se /Namen			EUR	11 570	-	-11 570	-	-	0.00
Walt Disney /Disney Ser			USD	7 322	169	-3 524	3 967	324 632.23	0.68
								21 956 632.76	46.32
Anleihen									
Allianz 2.625% 20-Perp	2.625	31.12.99	EUR	400 000	200 000	-	600 000	421 377.00	0.89
Alpha Train	2.064	30.06.25	EUR	250 000	-	-	250 000	234 326.25	0.49
Amer Movil 2.125% 16-10.03.28	2.125	10.03.28	EUR	200 000	-	-	200 000	184 742.22	0.39
Ascendas Re 0.75% 21-23.06.28	0.750	23.06.28	EUR	390 000	-	-	390 000	312 116.22	0.66
Austria 2.1% 17-20.09.2117	2.100	20.09.17	EUR	100 000	-	-	100 000	73 797.60	0.16
Bco Sab 0.875% 19-22.07.25	0.875	22.07.25	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Bng 0.625% 17-19.06.27 Regs	0.625	19.06.27	EUR	300 000	-	-	300 000	270 911.10	0.57
Bnp Par 1.125% 20-15.01.32 Regs	1.125	15.01.32	EUR	-	500 000	-	500 000	425 850.77	0.90
Btps 1.65% 15-01.03.32 /Btp	1.650	01.03.32	EUR	400 000	130 000	-	530 000	444 667.88	0.94
Cadent Fina 0.75% 20-11.03.32	0.750	11.03.32	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Chile 0.83% 19-02.07.31	0.830	02.07.31	EUR	265 000	-	-	265 000	209 103.55	0.44
Comcast 0.75% 20-20.02.32	0.750	20.02.32	EUR	200 000	-	-	200 000	157 395.40	0.33
Cs Group 1.25% 17-17.07.25	1.250	17.07.25	EUR	280 000	-	-280 000	-	-	0.00
Dbs Group 1.5% 18-11.04.28	1.500	11.04.28	EUR	250 000	100 000	-350 000	-	-	0.00
Deut Bk 1.375% 21-17.02.32	1.375	17.02.32	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Deutschland 0.0% 20-15.08.50	0.000	15.08.50	EUR	1 050 000	-	-1 050 000	-	-	0.00
Digital Dut 1.0% 20-15.01.32	1.000	15.01.32	EUR	113 000	-	-	113 000	79 927.73	0.17
Digital Int 0.625% 21-15.07.31	0.625	15.07.31	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Eib	3.500	15.04.27	EUR	490 000	-	-	490 000	494 760.84	1.04
Eib	0.125	15.04.25	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Eu 0.0% 20-04.07.35	0.000	04.07.35	EUR	320 000	-	-	320 000	221 075.84	0.47
Fer D Stato 1.5% 17-27.06.25	1.500	27.06.25	EUR	150 000	-	-	150 000	142 587.60	0.30
Fidelity NI 1% 19-03.12.28	1.000	03.12.28	EUR	400 000	-	-	400 000	341 328.80	0.72
Fluxys	2.750	27.11.29	EUR	300 000	-	-	300 000	269 645.40	0.57
France	2.750	25.10.27	EUR	950 000	700 000	-475 000	1 175 000	1 166 592.88	2.46
France 2.25% 13-25.05.24 /Oat	2.250	25.05.24	EUR	-	820 000	-	820 000	811 033.30	1.71
France 4% 04-25.04.55 Oat	4.000	25.04.55	EUR	-	1 020 000	-670 000	350 000	400 239.88	0.84
France 4.75% 04-25.04.35 Oat	4.750	25.04.35	EUR	575 000	-	-	575 000	670 950.94	1.41
Germany	4.750	04.07.28	EUR	1 315 000	180 000	-615 000	880 000	970 686.11	2.05
Germany	5.500	04.01.31	EUR	775 000	430 000	-525 000	680 000	821 844.60	1.73
Germany	4.750	04.07.34	EUR	1 680 000	850 000	-1 380 000	1 150 000	1 406 928.40	2.97
Germany 2% 13-15.08.23	2.000	15.08.23	EUR	-	3 390 000	-2 456 553	933 447	932 083.08	1.97
Germany 4.25% 07-04.07.39	4.250	04.07.39	EUR	1 000 000	1 050 000	-500 000	1 550 000	1 903 937.85	4.02
Gldm Sachs G 3.375% 27.03.25	3.375	27.03.25	EUR	550 000	-	-	550 000	542 708.65	1.14
Illinois To 2.125% 15-22.05.30	2.125	22.05.30	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Ireland 2.4% 14-15.05.30	2.400	15.05.30	EUR	-	430 000	-	430 000	420 131.26	0.89
Italy 5.25% 98-29 Btp	5.250	01.11.29	EUR	-	500 000	-	500 000	543 001.50	1.14
Kkr Group Fin 1.625% 22.05.29	1.625	22.05.29	EUR	440 000	250 000	-690 000	-	-	0.00
Lloyds Bank 2.375% 20-09.04.26	2.375	09.04.26	EUR	217 000	-	-	217 000	206 867.84	0.44
Lse 0.875% 17-19.09.24	0.875	19.09.24	EUR	300 000	-	-	300 000	288 866.11	0.61
Merck	1.875	15.10.26	EUR	250 000	-	-	250 000	236 205.64	0.50
Mexico Cete 1.125% 20-17.01.30	1.125	17.01.30	EUR	165 000	-	-	165 000	136 490.97	0.29
Ndaq 0.875% 20-13.02.30	0.875	13.02.30	EUR	505 000	-	-505 000	-	-	0.00
Netherlands	4.000	15.01.37	EUR	430 000	50 000	-	480 000	545 553.60	1.15
Orange 1.625% 20-07.04.32	1.625	07.04.32	EUR	100 000	-	-	100 000	85 674.20	0.18
Orange 1.75% 20-Perp	1.750	31.12.99	EUR	200 000	-	-	200 000	168 352.33	0.35
Phoenix Gr 4.375% 18-24.01.29	4.375	24.01.29	EUR	250 000	100 000	-	350 000	318 702.60	0.67
Portugal 4.1% 15-15.02.45	4.100	15.02.45	EUR	210 000	20 000	-	230 000	250 525.89	0.53
Rabobk Ny 0.875% 20-05.05.28	0.875	05.05.28	EUR	400 000	-	-	400 000	350 799.20	0.74
Rff 4.5% 09-30.01.24	4.500	30.01.24	EUR	-	150 000	-	150 000	150 515.10	0.32
Rff 5% 03-10.10.33	5.000	10.10.33	EUR	-	300 000	-	300 000	340 871.70	0.72
Rte	2.000	18.04.36	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Selp Financ 0.875% 21-27.05.29	0.875	27.05.29	EUR	700 000	-	-	700 000	547 417.50	1.15
Spain 1.5% 17-30.04.27	1.500	30.04.27	EUR	460 000	140 000	-	600 000	562 410.60	1.19

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Spain 5.9% 11-30.07.26	5.900	30.07.26	EUR	970 000	-	-	970 000	1 041 261.15	2.20
Spbk Bolikr 0.5% 18-30.01.25	0.500	30.01.25	EUR	-	450 000	-	450 000	426 809.07	0.90
Sr-Bolig 0.01% 20-25.02.30	0.010	25.02.30	EUR	292 000	-	-	292 000	234 405.34	0.49
Sse 1.75% 20-16.04.30	1.750	16.04.30	EUR	300 000	200 000	-	500 000	438 797.50	0.93
Sse 3.125% 20-Perp	3.125	31.12.99	EUR	400 000	-	-200 000	200 000	181 907.80	0.38
Standard Frn 20-09.09.30	0.000	09.09.30	EUR	152 000	-	-	152 000	141 202.69	0.30
Tennet 2% 18-05.06.34	2.000	05.06.34	EUR	200 000	100 000	-	300 000	259 283.23	0.55
Thames Wat 0.875% 22-31.01.28	0.875	31.01.28	EUR	130 000	200 000	-330 000	-	-	0.00
Thermo Fish 1.75% 20-15.04.27	1.750	15.04.27	EUR	102 000	200 000	-	302 000	281 208.21	0.59
Verbund 0.90% 21-01.04.41	0.900	01.04.41	EUR	200 000	100 000	-	300 000	206 652.00	0.44
Verizon Com 1.85% 20-18.05.40	1.850	18.05.40	EUR	-	730 000	-	730 000	528 899.60	1.12
Virgin Mney 2.875% 20-24.06.25	2.875	24.06.25	EUR	700 000	120 000	-400 000	420 000	407 037.13	0.86
York Build 0.625% 20-21.09.25	0.625	21.09.25	EUR	125 000	-	-	125 000	115 566.88	0.24
								23 326 036.53	49.21

Optionsscheine

Wt Carbon Perp Cert		31.12.99	GBP	32 887	8 625	-32 167	9 345	274 205.02	0.58
								274 205.02	0.58

Indexoptionen

Euro Stoxx 50 Pr		15.09.23	EUR	-	17	-	17	10 166.00	0.02
Euro Stoxx 50 Pr		15.09.23	EUR	-	-	-17	-17	-1 581.00	0.00
Msci Worl Net Index - M1wo		19.06.23	USD	-	47	-47	-	-	0.00
Msci Worl Net Index - M1wo		19.06.23	USD	-	47	-47	-	-	0.00
Msci Worl Net Index - M1wo		19.12.22	USD	-	19	-19	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.12.23	USD	-	-	-6	-6	-24 428.96	-0.05
Spx - S&P 500 Indices		15.12.23	USD	-	6	-	6	44 540.79	0.09
Spx - S&P 500 Indices		15.09.23	USD	-	-	-2	-2	-989.92	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.09.23	USD	-	2	-	2	3 297.89	0.01
								31 004.80	0.07

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

45 587 879.11 96.18

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Spain 3.45% 16-30.07.66	3.450	30.07.66	EUR	360 000	140 000	-170 000	330 000	300 115.20	0.63
								300 115.20	0.63

Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere

300 115.20 0.63

Sonstige übertragbare Wertpapiere

Anleihen

Intl Fin 4.25% 20-16.07.25	4.250	16.07.25	BRL	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
								-	0.00

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Anlagefonds									
Pictet-Stmm Chf -I- Chf /Cap			CHF	-	13 999	-13 999	-	-	0.00
Quaer C Argon -B- Eur/Cap			EUR	3 660	-	-1 357	2 303	702 246.85	1.48
								702 246.85	1.48
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere								702 246.85	1.48
SUMME WERTPAPIERBESTAND								46 590 241.16	98.29
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								188 745.21	0.40
Sonstige Aktiven								620 273.31	1.31
GESAMTNETTOVERMÖGEN								47 399 259.68	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Aia Group Ltd			HKD	60 000	4 800	-2 000	62 800	581 008.48	2.91
Air Liquide			EUR	3 053	48	-1 323	1 778	291 947.60	1.46
Alibaba Group Holding Ltd			HKD	16 380	-	-16 380	-	-	0.00
Alphabet Inc -A-			USD	-	7 695	-156	7 539	827 147.85	4.15
Alphabet Inc -C-			USD	322	7 229	-7 551	-	-	0.00
Amazon Com Inc			USD	6 300	661	-238	6 723	803 309.15	4.03
American Tower Corp			USD	1 716	16	-1 732	-	-	0.00
Amgen Inc			USD	2 384	270	-1 314	1 340	272 691.84	1.37
Aramark Holdings Corp			USD	7 568	3 883	-352	11 099	437 957.79	2.19
Asml Holding Nv			EUR	972	10	-318	664	440 232.00	2.21
Cme Group Inc			USD	2 155	931	-93	2 993	508 316.20	2.55
Colgate-Palmolive Co.			USD	3 237	1 064	-138	4 163	293 966.56	1.47
Costco Wholesale Corp			USD	957	8	-965	-	-	0.00
D S Smith Plc			GBP	78 609	13 104	-51 249	40 464	128 161.81	0.64
Daikin Industries Ltd			JPY	2 000	200	-1 300	900	167 029.54	0.84
Deere & Co.			USD	791	12	-85	718	266 660.33	1.34
Draper Esprit Plc			GBP	9 110	133	-9 243	-	-	0.00
Dsm-Firmenich Ltd			EUR	-	2 792	-21	2 771	273 276.02	1.37
Ecolab Inc.			USD	-	2 249	-40	2 209	378 000.19	1.89
Edwards Lifesciences			USD	3 841	1 136	-145	4 832	417 784.20	2.09
Entegris Inc			USD	-	4 140	-4 140	-	-	0.00
Equinix Inc /Reit			USD	480	66	-189	357	256 522.99	1.29
Equinor Asa			NOK	-	13 545	-359	13 186	352 086.92	1.76
Essilor International			EUR	2 296	36	-1 029	1 303	224 897.80	1.13
Housing Devt. Fin. Corp /Adr			USD	5 844	103	-2 089	3 858	246 473.51	1.24
Illumina Inc			USD	1 770	32	-60	1 742	299 365.33	1.50
Intl Flavors Frag			USD	2 982	1 756	-2 031	2 707	197 479.50	0.99
Inv Rg-B			SEK	16 463	242	-16 705	-	-	0.00
Koninklijke Dsm Nv			EUR	1 573	1 243	-2 816	-	-	0.00
Lse Group			GBP	5 678	410	-2 838	3 250	316 841.16	1.59
Mastercard Inc. Shs-A-			USD	2 045	33	-823	1 255	452 421.17	2.27
Medtronic Holdings Limited			USD	4 755	2 054	-211	6 598	532 799.08	2.67
Meituan			HKD	-	780	-780	-	-	0.00
Merck			USD	4 980	94	-426	4 648	491 597.36	2.46
Microsoft Corp			USD	2 601	207	-692	2 116	660 479.05	3.31
Middleby Corp			USD	2 174	39	-350	1 863	252 435.65	1.26
Msci Inc -A-			USD	884	46	-918	12	5 161.76	0.03
Otis Worldwide Corporation			USD	6 054	340	-2 263	4 131	337 030.53	1.69
Palo Alto Networks Inc			USD	-	1 640	-173	1 467	343 568.44	1.72
Paypal Holdings Inc			USD	4 345	83	-4 428	-	-	0.00
Reckitt Benckiser Group Plc			GBP	-	6 662	-137	6 525	449 526.52	2.25
Samsonite International			HKD	153 000	15 300	-27 000	141 300	365 242.06	1.83
Service Corp International			USD	-	4 900	-101	4 799	284 113.12	1.42
Servicenow Inc			USD	630	164	-104	690	355 416.41	1.78
Shiseido Co.Ltd			JPY	6 400	3 600	-300	9 700	399 410.43	2.00
Siemens Ag /Nam.			EUR	2 262	297	-616	1 943	296 385.22	1.49
Smith And Nephew Plc			GBP	22 351	-	-22 351	-	-	0.00
Splunk Inc			USD	2 852	736	-3 588	-	-	0.00
Svb Financial Group			USD	721	9	-730	-	-	0.00
Taiwan Semiconduct. Manuf/Sadr			USD	-	6 376	-93	6 283	581 191.90	2.91
Teleflex Inc			USD	1 251	22	-1 273	-	-	0.00
Tencent Holdings Ltd			HKD	6 400	3 600	-300	9 700	376 211.96	1.89
Tetra Tech Inc.			USD	-	1 390	-	1 390	208 614.67	1.05
Unilever Plc			EUR	-	3 083	-63	3 020	144 084.20	0.72

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR) (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Vonovia Se /Namen			EUR	9 833	-	-9 833	-	-	0.00
Walt Disney /Disney Ser			USD	4 183	477	-1 420	3 240	265 139.51	1.33
								14 781 985.81	74.09
Anleihen									
Alpha Train	2.064	30.06.25	EUR	100 000	-	-	100 000	93 730.50	0.47
Ascendas Re 0.75% 21-23.06.28	0.750	23.06.28	EUR	240 000	-	-100 000	140 000	112 041.72	0.56
Bco Sab 0.875% 19-22.07.25	0.875	22.07.25	EUR	100 000	-	-	100 000	92 775.10	0.47
Btps 1.65% 15-01.03.32 /Btp	1.650	01.03.32	EUR	-	250 000	-	250 000	209 749.00	1.05
Dbs Group 1.5% 18-11.04.28	1.500	11.04.28	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Deutschland 0.0% 20-15.08.50	0.000	15.08.50	EUR	125 000	-	-125 000	-	-	0.00
Digital Int 0.625% 21-15.07.31	0.625	15.07.31	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Fidelity NI 1% 19-03.12.28	1.000	03.12.28	EUR	100 000	-	-	100 000	85 332.20	0.43
Fluxys	2.750	27.11.29	EUR	100 000	-	-	100 000	89 881.80	0.45
France 2.25% 13-25.05.24 /Oat	2.250	25.05.24	EUR	-	160 000	-	160 000	158 250.40	0.79
France 2.75% 25.10.27 Oat Regs	2.750	25.10.27	EUR	-	350 000	-	350 000	347 495.75	1.74
France 4% 04-25.04.55 Oat	4.000	25.04.55	EUR	-	280 000	-130 000	150 000	171 531.38	0.86
France 4.75% 04-25.04.35 Oat	4.750	25.04.35	EUR	95 000	15 000	-	110 000	128 355.83	0.64
Germany	4.750	04.07.28	EUR	75 000	210 000	-	285 000	314 369.93	1.58
Germany	5.500	04.01.31	EUR	-	130 000	-	130 000	157 117.35	0.79
Germany	4.750	04.07.34	EUR	200 000	40 000	-240 000	-	-	0.00
Germany 2% 13-15.08.23	2.000	15.08.23	EUR	-	320 000	-130 000	190 000	189 722.41	0.95
Germany 4.25% 07-04.07.39	4.250	04.07.39	EUR	200 000	110 000	-	310 000	380 787.57	1.91
Ireland 2.4% 14-15.05.30	2.400	15.05.30	EUR	-	400 000	-40 000	360 000	351 737.80	1.76
Italy 3.1% 11-15.09.26 Btp /Infl	3.100	15.09.26	EUR	160 000	-	-160 000	-	-	0.00
Italy 5.25% 98-29 Btp	5.250	01.11.29	EUR	-	100 000	-	100 000	108 600.30	0.54
Kkr Group Fin 1.625% 22.05.29	1.625	22.05.29	EUR	100 000	100 000	-	200 000	169 203.84	0.85
Lloyds Bk 1.75% 18-07.09.28	1.750	07.09.28	EUR	100 000	-	-	100 000	99 252.90	0.50
Mexico Cete 1.125% 20-17.01.30	1.125	17.01.30	EUR	100 000	-	-	100 000	82 721.80	0.41
Netherlands	4.000	15.01.37	EUR	150 000	20 000	-	170 000	193 216.90	0.97
Portugal 4.1% 15-15.02.45	4.100	15.02.45	EUR	45 000	5 000	-	50 000	54 462.15	0.27
Rbs Group 0.75% 19-15.11.25	0.750	15.11.25	EUR	100 000	-	-	100 000	94 747.20	0.47
Rte	2.000	18.04.36	EUR	100 000	-	-	100 000	82 342.10	0.41
Spain 1.5% 17-30.04.27	1.500	30.04.27	EUR	-	50 000	-	50 000	46 867.55	0.24
Sse 1.75% 20-16.04.30	1.750	16.04.30	EUR	210 000	-	-	210 000	184 294.95	0.92
Sse 3.125% 20-Perp	3.125	31.12.99	EUR	133 000	-	-	133 000	120 968.69	0.61
Verizom Com 1.85% 20-18.05.40	1.850	18.05.40	EUR	106 000	-	-	106 000	76 799.12	0.39
Virgin Mney 2.875% 20-24.06.25	2.875	24.06.25	EUR	200 000	-	-	200 000	193 827.21	0.97
								4 390 183.45	22.00
Optionsscheine									
Wt Carbon Perp Cert		31.12.99	GBP	16 365	12 369	-23 561	5 173	151 788.40	0.76
								151 788.40	0.76
Indexoptionen									
Euro Stoxx 50 Pr		15.09.23	EUR	-	7	-	7	4 186.00	0.02
Euro Stoxx 50 Pr		15.09.23	EUR	-	-	-7	-7	-651.00	0.00
Msci Worl Net Index - M1wo		19.06.23	USD	-	20	-20	-	-	0.00
Msci Worl Net Index - M1wo		19.06.23	USD	-	20	-20	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.09.23	USD	-	-	-1	-1	-494.96	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.12.23	USD	-	2	-	2	14 846.93	0.07
Spx - S&P 500 Indices		15.12.23	USD	-	-	-2	-2	-8 142.99	-0.04
Spx - S&P 500 Indices		15.09.23	USD	-	1	-	1	1 648.95	0.01
								11 392.93	0.06
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								19 335 350.59	96.91

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR) (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden									
Anleihen									
Spain 3.45% 16-30.07.66	3.450	30.07.66	EUR	10 000	20 000	-	30 000	27 283.20	0.14
								27 283.20	0.14
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								27 283.20	0.14
Sonstige übertragbare Wertpapiere									
Anlagefonds									
Pictet-Stmm Chf- -I- Chf /Cap			CHF	-	5 515	-5 515	-	-	0.00
Quaer C Argon -B- Eur/Cap			EUR	1 875	-	-403	1 472	448 897.16	2.25
								448 897.16	2.25
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere								448 897.16	2.25
SUMME WERTPAPIERBESTAND								19 811 530.95	99.30
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								2 984.21	0.01
Sonstige Aktiven								136 982.25	0.69
GESAMTNETTOVERMÖGEN								19 951 497.41	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Twelve Sustainable Insurance Bond

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
Achmea Bv 2.50% 19-24.09.39	2.500	24.09.39	EUR	3 000 000	3 000 000	-	6 000 000	4 806 876.00	1.13
Achmea Bv 4.25% 15-Perp	4.250	31.12.99	EUR	11 034 000	-	-6 000 000	5 034 000	4 899 189.48	1.15
Achmea Bv 4.625% 19-Perp Regs	4.625	31.12.99	EUR	4 781 000	-	-1 000 000	3 781 000	2 942 090.63	0.69
Achmea Bv 6.75% 23-26.12.43	6.750	26.12.43	EUR	-	1 550 000	-	1 550 000	1 562 293.05	0.37
Aegon 5.185% 96-..	5.185	31.12.99	NLG	15 980 000	-	-	15 980 000	5 068 008.95	1.19
Aegon Nv 1.506%-.. /Stp-Dwn	1.506	31.12.99	NLG	11 460 000	-	-	11 460 000	4 075 335.77	0.96
Aegon Nv 4.26%	4.260	31.12.99	NLG	7 500 000	-	-	7 500 000	2 141 388.84	0.50
Ag Insur 3.5% 15-30.06.47	3.500	30.06.47	EUR	-	8 500 000	-	8 500 000	7 812 078.00	1.84
Ageas Fin 1.875% 20-24.11.51	1.875	24.11.51	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	728 458.00	0.17
Allianz 4.252% 22-05.07.52	4.252	05.07.52	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	929 736.00	0.22
Allianz Se	3.375	31.12.99	EUR	2 700 000	3 500 000	-2 000 000	4 200 000	4 096 646.40	0.96
Asr	5.125	29.09.45	EUR	6 440 000	3 000 000	-	9 440 000	9 313 258.56	2.19
Asr 7.0% 22-07.12.43	7.000	07.12.43	EUR	-	7 900 000	-	7 900 000	8 237 108.80	1.94
Assgen	5.500	27.10.47	EUR	7 050 000	-	-3 000 000	4 050 000	4 083 169.50	0.96
Assgen 5.399% 23-20.04.33	5.399	20.04.33	EUR	-	1 300 000	-	1 300 000	1 317 267.90	0.31
Assicuraz Gen.06.269% 06-..Perp	6.269	31.12.99	GBP	2 550 000	-	-	2 550 000	2 889 329.25	0.68
Athora Hold 6.625% 23-16.06.28	6.625	16.06.28	EUR	-	4 200 000	-	4 200 000	4 164 703.20	0.98
Atradius Fi 5.25% 14-23.09.44	5.250	23.09.44	EUR	3 227 000	-	-950 000	2 277 000	2 236 407.92	0.53
Aviva 3.375% 15-04.12.45	3.375	04.12.45	EUR	-	3 000 000	-	3 000 000	2 843 814.00	0.67
Aviva 6.125% 01-14.11.36	6.125	14.11.36	GBP	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Aviva 6.875% 22-Perp	6.875	31.12.99	GBP	2 300 000	-	-1 000 000	1 300 000	1 263 774.34	0.30
Aviva Plc	6.125	31.12.99	GBP	4 710 000	-	-4 710 000	-	-	0.00
Axa	3.875	31.12.99	EUR	10 000 000	-	-	10 000 000	9 629 945.70	2.27
Axa	0.000	31.12.99	EUR	2 033 000	-	-	2 033 000	1 622 862.58	0.38
Axa 3.941% (Frn) 14-Perp	3.941	31.12.99	EUR	-	4 600 000	-	4 600 000	4 490 009.40	1.06
Axa 5.453% (Frn) 14-Perp	5.453	31.12.99	GBP	9 500 000	-	-	9 500 000	10 765 980.58	2.53
Axa 6.6862% 06-Perp	6.686	31.12.99	GBP	2 500 000	-	-	2 500 000	2 907 018.69	0.68
Cattol Ass 4.25% 17-14.12.47	4.250	14.12.47	EUR	10 400 000	-	-2 000 000	8 400 000	8 085 533.40	1.90
Chesnara Pl 4.75% 22-04.08.32	4.750	04.08.32	GBP	4 000 000	1 800 000	-	5 800 000	4 895 901.88	1.15
Cloverie 5.625% 16-24.06.46	5.625	24.06.46	USD	-	4 000 000	-	4 000 000	3 614 262.14	0.85
Cloverie Pl	4.500	11.09.44	USD	2 015 000	-	-2 015 000	-	-	0.00
Cnp Assur 4.25% 14-05.06.45	4.250	05.06.45	EUR	-	4 000 000	-4 000 000	-	-	0.00
Cnp Assurances	0.000	31.12.99	EUR	5 921 000	-	-	5 921 000	4 803 707.30	1.13
Crdt Agr As	4.750	27.09.48	EUR	4 000 000	11 600 000	-6 900 000	8 700 000	8 374 106.70	1.97
Crdt Agr As 4.25% 15-Perp	4.250	31.12.99	EUR	-	4 000 000	-	4 000 000	3 902 284.00	0.92
Crdt Agr As 4.5% 14-Perp	4.500	31.12.99	EUR	3 800 000	-	-	3 800 000	3 693 439.15	0.87
Direct Line 4.0% 20-05.06.32	4.000	05.06.32	GBP	4 760 000	-	-	4 760 000	4 013 570.38	0.94
Direct Line 4.75% 17-Perp Regs	4.750	31.12.99	GBP	5 990 000	-	-	5 990 000	4 663 289.95	1.10
Esure	6.750	19.12.24	GBP	3 300 000	-	-2 960 000	340 000	394 223.38	0.09
Ethias Sa 6.75% 05.05.33 Regs	6.750	05.05.33	EUR	-	7 000 000	-	7 000 000	6 969 025.00	1.64
Fidelidade 4.25% 21-04.09.31	4.250	04.09.31	EUR	7 500 000	-	-	7 500 000	6 510 810.00	1.53
Fondiaría	5.750	31.12.99	EUR	14 752 000	1 400 000	-	16 152 000	15 994 518.00	3.76
Fondiaría 3.875% 18-01.03.28	3.875	01.03.28	EUR	4 450 000	-	-500 000	3 950 000	3 784 218.50	0.89
Generali Fi 4.596% 14-Perp Regs	4.596	31.12.99	EUR	7 700 000	-	-7 700 000	-	-	0.00
Hanno Rueck 5.875% 22-26.08.43	5.875	26.08.43	EUR	-	9 000 000	-	9 000 000	9 395 397.00	2.21
Hiscox Ltd	6.125	24.11.45	GBP	10 297 000	100 000	-4 000 000	6 397 000	7 081 482.79	1.67
Just Grp 5% (Frn) 21-Perp Regs	5.000	31.12.99	GBP	5 000 000	-	-	5 000 000	3 736 137.57	0.88
Just Grp 8.125% 19-26.10.29	8.125	26.10.29	GBP	3 700 000	-	-	3 700 000	4 372 753.56	1.03
Just Retirement	9.000	26.10.26	GBP	4 411 000	-	-4 411 000	-	-	0.00
L&G Grp 5.25% (Frn) 17-21.03.47	5.250	21.03.47	USD	7 831 000	-	-3 000 000	4 831 000	4 220 482.93	0.99
L&G Grp Plc 5.125% 18-14.11.48	5.125	14.11.48	GBP	3 500 000	-	-	3 500 000	3 671 655.96	0.86
L&G Grp Plc 5.375% 15-27.10.45	5.375	27.10.45	GBP	3 500 000	-	-1 000 000	2 500 000	2 765 948.24	0.65
La Mondiale	5.050	31.12.99	EUR	10 500 000	580 000	-1 000 000	10 080 000	9 904 053.60	2.33
Mapfre 4.375% (Frn) 17-31.03.47	4.375	31.03.47	EUR	5 700 000	1 800 000	-2 000 000	5 500 000	5 230 406.50	1.23

JSS Twelve Sustainable Insurance Bond (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Munich Re 1.25% 20-26.05.41	1.250	26.05.41	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 146 975.00	0.27
Munich Re 3.25% 18-26.05.49	3.250	26.05.49	EUR	3 300 000	1 500 000	-	4 800 000	4 366 492.80	1.03
Nn Group	4.500	31.12.99	EUR	3 600 000	7 500 000	-1 500 000	9 600 000	9 299 470.75	2.19
Nn Group 4.625% 17-13.01.48	4.625	13.01.48	EUR	4 982 000	5 000 000	-1 500 000	8 482 000	8 196 792.75	1.93
Pension Ins	8.000	23.11.26	GBP	6 711 000	-	-	6 711 000	7 798 653.86	1.83
Pension Ins 7.375% 19-Perp	7.375	31.12.99	GBP	1 000 000	-	-	1 000 000	991 176.39	0.23
Phoenix Gr 4.375% 18-24.01.29	4.375	24.01.29	EUR	8 237 000	1 500 000	-	9 737 000	8 866 306.46	2.09
Phoenix Gr 5.375% 17-06.07.27	5.375	06.07.27	USD	3 100 000	-	-3 100 000	-	-	0.00
Phoenix Gr 5.75% 18-Perp	5.750	31.12.99	GBP	2 000 000	-	-	2 000 000	1 823 724.19	0.43
Qbe Ins 2.50% 13.09.38 Regs	2.500	13.09.38	GBP	8 950 000	-	-1 500 000	7 450 000	6 645 005.13	1.56
Qbe Ins 5.875% 16-17.06.46	5.875	17.06.46	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 749 420.09	0.41
Qbe Ins 6.75% 14-02.12.44	6.750	02.12.44	USD	3 800 000	-	-3 800 000	-	-	0.00
Quilter 8.625% 23-18.04.33	8.625	18.04.33	GBP	-	2 600 000	-	2 600 000	3 091 466.87	0.73
Ri Finance 6.125% 15-13.11.28	6.125	13.11.28	GBP	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Rothsay Li	8.000	30.10.25	GBP	7 420 000	-	-	7 420 000	8 632 060.76	2.03
Rothsay Li 3.375% 19-12.07.26 Regs	3.375	12.07.26	GBP	3 860 000	2 900 000	-	6 760 000	6 997 026.01	1.65
Rothsay Li 5.5% 19-17.09.29 Regs	5.500	17.09.29	GBP	-	5 000 000	-	5 000 000	5 655 555.61	1.33
Rothsay Li 6.875% 18-Perp	6.875	31.12.99	GBP	2 848 000	-	-	2 848 000	2 748 310.32	0.65
Sanpaolo Vi 4.75% /Frn 14-Perp	4.750	31.12.99	EUR	12 100 000	200 000	-1 000 000	11 300 000	11 009 284.90	2.59
Scor Se	3.000	08.06.46	EUR	-	4 900 000	-	4 900 000	4 606 034.30	1.08
Scor Se 3.875% 14-Perp	3.875	31.12.99	EUR	-	3 700 000	-	3 700 000	3 517 368.00	0.83
Scor Se 5.25% 18-Perp	5.250	31.12.99	USD	1 200 000	3 600 000	-2 600 000	2 200 000	1 531 002.38	0.36
Sogecap Sa 4.125%/Frn 14-Perp	4.125	31.12.99	EUR	-	6 800 000	-	6 800 000	6 483 811.29	1.52
Swiss Life	4.375	31.12.99	EUR	5 000 000	-	-	5 000 000	4 895 091.10	1.15
Talanx 1.75% 21-01.12.42	1.750	01.12.42	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 123 276.50	0.26
Unipolsai 6.375% 20-Perp	6.375	31.12.99	EUR	6 900 000	-	-	6 900 000	5 987 785.50	1.41
Uniqa	6.000	27.07.46	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Uniqa 2.375% 21-09.12.41	2.375	09.12.41	EUR	6 000 000	-	-	6 000 000	4 442 160.00	1.04
Uniqa 3.25% 20-09.10.35	3.250	09.10.35	EUR	5 000 000	1 600 000	-200 000	6 400 000	5 935 424.00	1.40
Utmost Grp 4.0% 21-15.12.31	4.000	15.12.31	GBP	6 500 000	300 000	-	6 800 000	5 741 001.75	1.35
Utmost Grp 6.125% 22-Perp	6.125	31.12.99	GBP	6 200 000	1 856 000	-	8 056 000	6 881 400.64	1.62
Vivat Nv 5.375% 22-31.08.32	5.375	31.08.32	EUR	-	7 000 000	-	7 000 000	6 484 765.00	1.53
Zuerich Ver	3.500	01.10.46	EUR	2 800 000	4 000 000	-2 800 000	4 000 000	3 759 400.00	0.88
Zurich Fin Uk 6.625% 03-Perp	6.625	31.12.99	GBP	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
							385 310 201.82	90.63	
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind							385 310 201.82	90.63	
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden									
Anleihen									
Beazley Re 5.50% 19-10.09.29	5.500	10.09.29	USD	5 150 000	-	-	5 150 000	4 342 804.77	1.02
Just Grp 7.0% 20-15.04.31	7.000	15.04.31	GBP	5 950 000	-	-	5 950 000	6 653 698.51	1.56
RI Fin 6 10.125% 23-Perp	10.125	31.12.99	GBP	-	3 500 000	-	3 500 000	4 022 494.30	0.95
							15 018 997.58	3.53	
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere							15 018 997.58	3.53	
SUMME WERTPAPIERBESTAND							400 329 199.40	94.16	
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen							18 636 415.66	4.38	
Sonstige Aktiven							6 186 525.88	1.46	
GESAMTNETTOVERMÖGEN							425 152 140.94	100.00	

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Global Thematic

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

.Taiwan Semiconduct.Manuf/Sadr			USD	-	228 881	-	228 881	21 172 016.98	2.16
Activision Blizzard Inc			USD	764 686	-	-367 107	397 579	30 720 357.20	3.13
Aia Group Ltd			HKD	3 041 800	506 000	-	3 547 800	32 823 278.49	3.34
Alibaba Group Holding Ltd			HKD	1 058 300	922 100	-	1 980 400	18 808 548.94	1.92
Alphabet Inc -A-			USD	16 205	412 462	-44 503	384 164	42 148 882.49	4.29
Alstom			EUR	-	534 346	-	534 346	14 598 332.72	1.49
Amazon Com Inc			USD	463 260	-	-70 784	392 476	46 895 665.77	4.78
Aramark Holdings Corp			USD	819 784	-	-338 375	481 409	18 996 019.66	1.93
Asml Holding Nv			EUR	33 147	6 632	-9 777	30 002	19 891 326.00	2.03
Asos Plc			GBP	1 337 216	-	-1 337 216	-	-	0.00
Booking Holdings Inc			USD	17 801	-	-10 803	6 998	17 320 723.50	1.76
Cme Group Inc			USD	-	166 433	-36 436	129 997	22 078 042.28	2.25
Daikin Industries Ltd			JPY	95 205	-	-37 700	57 505	10 672 259.98	1.09
Deere & Co.			USD	48 741	-	-11 510	37 231	13 827 340.87	1.41
Dsm-Firmenich Ltd			EUR	-	119 370	-	119 370	11 772 269.40	1.20
Ebay Inc			USD	699 065	-	-699 065	-	-	0.00
Ecolab Inc.			USD	-	198 809	-	198 809	34 019 846.21	3.47
Edwards Lifesciences			USD	212 118	-	-36 000	176 118	15 227 507.74	1.55
Entegris Inc			USD	306 898	-	-158 936	147 962	15 029 467.31	1.53
Essilor International			EUR	275 311	17 213	-219 488	73 036	12 606 013.60	1.28
Facebook Inc -A-			USD	201 875	-	-50 326	151 549	39 863 915.69	4.06
Fomento Economico Mexicano / Adr			USD	421 625	-	-225 914	195 711	19 883 233.03	2.03
Illumina Inc			USD	96 292	-	-	96 292	16 547 925.83	1.69
Intl Flavors Frag			USD	215 627	-	-	215 627	15 730 295.99	1.60
Keyence Corp			JPY	37 100	-	-	37 100	15 963 422.99	1.63
Koninklijke Dsm Nv			EUR	-	86 810	-86 810	-	-	0.00
Lilly (Eli) & Co			USD	77 617	-	-77 617	-	-	0.00
Lse Group			GBP	414 964	-	-88 832	326 132	31 794 474.46	3.24
Medtronic Holdings Limited			USD	336 028	-	-	336 028	27 134 800.00	2.76
Merck			USD	262 249	35 262	-101 195	196 316	20 763 431.02	2.12
Microsoft Corp			USD	228 349	-	-106 150	122 199	38 142 664.95	3.89
Middleby Corp			USD	163 109	-	-48 721	114 388	15 499 521.58	1.58
Msci Inc -A-			USD	34 279	-	-34 279	-	-	0.00
Otis Worldwide Corporation			USD	296 821	-	-114 068	182 753	14 910 031.65	1.52
Paypal Holdings Inc			USD	363 174	-	-363 174	-	-	0.00
Prudential Plc			GBP	-	1 345 036	-	1 345 036	17 374 406.68	1.77
Reckitt Benckiser Group Plc			GBP	648 729	105 540	-223 349	530 920	36 576 646.74	3.73
Sealed Air Corp (New)			USD	539 687	-	-539 687	-	-	0.00
Servicenow Inc			USD	55 409	18 211	-35 052	38 568	19 866 231.86	2.02
Shiseido Co.Ltd			JPY	534 596	78 300	-89 600	523 296	21 547 410.12	2.19
Siemens Ag /Nam.			EUR	337 207	-	-229 203	108 004	16 474 930.16	1.68
Smith And Nephew Plc			GBP	2 502 059	-	-783 487	1 718 572	25 393 780.55	2.59
Splunk Inc			USD	412 803	-	-199 539	213 264	20 738 018.11	2.11
Statoil Asa			NOK	825 040	134 982	-263 845	696 177	18 589 019.62	1.89
Teleflex Inc			USD	174 650	-	-53 841	120 809	26 800 552.03	2.73
Tetra Tech Inc.			USD	-	134 764	-	134 764	20 225 717.10	2.06
Under Armour Inc /-A-			USD	2 995 835	-	-544 533	2 451 302	16 222 181.89	1.65
Unilever Plc			EUR	-	315 368	-	315 368	15 046 207.28	1.53

JSS Sustainable Equity - Global Thematic (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Walt Disney /Disney Ser			USD	385 390	-	-73 331	312 059	25 536 780.50	2.60
Zoetis Inc -A-			USD	77 609	31 694	-	109 303	17 253 042.74	1.76
							952 486 541.71	97.04	
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								952 486 541.71	97.04
SUMME WERTPAPIERBESTAND								952 486 541.71	97.04
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								27 801 530.09	2.83
Sonstige Aktiven								1 290 398.66	0.13
GESAMTNETTOVERMÖGEN								981 578 470.46	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Global Short-term

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
Aadb Fin	4.500	06.03.23	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Afrefbk 5.25% 18-11.10.23	5.250	11.10.23	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 993 964.00	0.76
Africa Fina 3.125% 20-16.06.25	3.125	16.06.25	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 793 570.00	1.07
Aia Group 3.2% 15-11.03.25	3.200	11.03.25	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Alibaba Grp 3.6% 15-28.11.24	3.600	28.11.24	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 937 828.94	0.74
Alpek	4.500	20.11.22	USD	282 000	-	-282 000	-	-	0.00
Axiata Spv2 4.357% 16-24.03.26	4.357	24.03.26	USD	300 000	200 000	-	500 000	484 122.50	0.18
B Latinam C 2.375% 20-14.09.25	2.375	14.09.25	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 857 373.60	0.71
Baidu Inc 1.625% 21-23.02.27	1.625	23.02.27	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Baidu Inc 3.875% 18-29.09.23	3.875	29.09.23	USD	-	2 180 000	-	2 180 000	2 169 132.70	0.83
Baidu Inc 4.375% 18-14.05.24	4.375	14.05.24	USD	-	3 400 000	-	3 400 000	3 353 385.15	1.28
Banbra 3.875% 10.10.22 144A	3.875	10.10.22	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Banbra 4.625% 17-15.01.25	4.625	15.01.25	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Banco 4.375% 11.04.27 Regs	4.375	11.04.27	USD	-	800 000	-	800 000	756 750.80	0.29
Banco Bilba 0.75% 17-11.09.22	0.750	11.09.22	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Banco De 3.5% 17-12.10.27 Regs	3.500	12.10.27	USD	-	1 800 000	-	1 800 000	1 663 054.74	0.64
Banco De Cred 4% 13-11.02.23	4.000	11.02.23	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Banco Inbur 4.125% 14-06.06.24	4.125	06.06.24	USD	500 000	500 000	-	1 000 000	981 278.30	0.38
Banco Peru 3.25% 19-04.10.26 Regs	3.250	04.10.26	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	931 144.12	0.36
Banco Vot 4.375% 29.07.25 Regs	4.375	29.07.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 921 613.80	0.74
Bancolumbia 3.0% 20-29.01.25	3.000	29.01.25	USD	3 500 000	-	-	3 500 000	3 327 558.85	1.27
Bangkok Bk 4.05% 18-19.03.24	4.050	19.03.24	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Bank Mandiri 2.0% 21-19.04.26	2.000	19.04.26	USD	500 000	-	-	500 000	452 255.98	0.17
Bank Mandiri 4.75% 20-13.05.25	4.750	13.05.25	USD	800 000	-	-	800 000	784 934.04	0.30
Bank Mandiri 5.50% 23-04.04.26	5.500	04.04.26	USD	-	500 000	-	500 000	499 925.91	0.19
Bank Rakyaty 4.625% 18-20.07.23	4.625	20.07.23	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 999 050.20	0.77
Banort 0.50% 20-06.12.24	0.500	06.12.24	CHF	-	1 000 000	-	1 000 000	1 072 766.32	0.41
Bbva 5% 12-26.08.22	5.000	26.08.22	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Bbva Bancom 4.375% 14-10.04.24	4.375	10.04.24	USD	300 000	4 000 000	-	4 300 000	4 237 147.89	1.62
Bc Sant Cl	3.875	20.09.22	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Bgaria-Flir 4.125% 22-23.09.29	4.125	23.09.29	EUR	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Bharat Petr	4.625	25.10.22	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Bharat Petr	4.000	08.05.25	USD	800 000	-	-	800 000	772 937.53	0.30
Bharti A 5.35% 14-20.05.24 Regs	5.350	20.05.24	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Bharti Airt 4.375% 15-10.06.25	4.375	10.06.25	USD	-	2 320 000	-	2 320 000	2 255 570.89	0.86
Bk Of China	5.000	13.11.24	USD	-	2 850 000	-	2 850 000	2 811 124.55	1.08
Blue Bright 2.50% 20-04.06.25	2.500	04.06.25	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Boad 5% 17-27.07.27 Regs	5.000	27.07.27	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	915 920.00	0.35
Boc Aviatio 2.625% 20-17.01.25	2.625	17.01.25	USD	300 000	-	-	300 000	285 311.68	0.11
Boc Aviatio 2.75% 20-02.12.23	2.750	02.12.23	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Bos Fund 4% 19-18.09.24 Regs	4.000	18.09.24	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Bprl Intern 4.375% 17-18.01.27	4.375	18.01.27	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 910 139.64	0.73
Bradesco 3.20% 20-27.01.25	3.200	27.01.25	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 433 040.00	0.55
Brf Gmbh 4.35% 16-29.09.26	4.350	29.09.26	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Btgbpz 5.5% 17-31.01.23 Regs	5.500	31.01.23	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Cbq Finance 1.115% 18-17.10.22	1.115	17.10.22	CHF	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Cbq Finance 5% 18-24.05.23	5.000	24.05.23	USD	300 000	1 330 000	-1 630 000	-	-	0.00
Cencosud 5.15% 15-12.02.25	5.150	12.02.25	USD	2 000 000	1 100 000	-	3 100 000	3 066 087.86	1.17
Cicc Hk Fin 1.625% 21-26.01.24	1.625	26.01.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Cimb Bk 2.125% 22-20.07.27	2.125	20.07.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Ck Hut 2.75% 17-29.03.23	2.750	29.03.23	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Cn Const Hk 3% 17-04.12.22	3.000	04.12.22	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Cnac Hk Fin 1.125% 20-22.09.24	1.125	22.09.24	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	2 078 140.79	0.80
Cofide 4.75% 15-15.07.25	4.750	15.07.25	USD	-	2 500 000	-	2 500 000	2 452 325.00	0.94

JSS Sustainable Bond - Global Short-term (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Colbun Sa 3.95% 17-11.10.27 Regs	3.950	11.10.27	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Colbun Sa 4.5% 14-10.07.24	4.500	10.07.24	USD	4 740 000	-	-4 740 000	-	-	0.00
Colombia 8.125% 04-21.05.24	8.125	21.05.24	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	2 042 010.00	0.78
Compet Team 3.75% 19-12.03.24	3.750	12.03.24	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 967 140.00	0.75
Contemporar 1.875% 20-17.09.25	1.875	17.09.25	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Credito 2.7% 19-11.01.25 Regs	2.700	11.01.25	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Credito 4.25% 13-01.04.23	4.250	01.04.23	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Croatia 6% 13-26.01.24	6.000	26.01.24	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 001 068.00	0.77
Cssc Cap 15 2.50% 20-13.02.25	2.500	13.02.25	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Dbs Group 4.52% 18-11.12.28	4.520	11.12.28	USD	300 000	1 700 000	-	2 000 000	1 985 530.00	0.76
Dib Sukuk 2.95% 19-20.02.25	2.950	20.02.25	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Doha Fin 2.375% 21-31.03.26	2.375	31.03.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 841 856.00	0.70
Dp World Cr 3.908% 16-31.05.23	3.908	31.05.23	USD	1 750 000	-	-1 750 000	-	-	0.00
Dp World Sa 6.0% 20-Perp	6.000	31.12.99	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 488 525.00	0.57
Ecopetrol 4.125% 14-16.01.25	4.125	16.01.25	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	961 318.30	0.37
Ecopetrol 5.375% 15-26.06.26	5.375	26.06.26	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 436 779.89	0.55
Ecopetrol 5.875% 13-18.09.23	5.875	18.09.23	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Eibk 4.25% 22-15.09.27	4.250	15.09.27	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Eibk 4.875% 23-11.01.26	4.875	11.01.26	USD	-	800 000	-800 000	-	-	0.00
Emg Sukuk	4.564	18.06.24	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	984 250.00	0.38
Emirate Frn 3.25% 17-14.11.22	3.250	14.11.22	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Emirate20 370-S Frn 5.625% 22-21.10.27	5.625	21.10.27	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 056 558.00	0.79
Emirate20 Frn 2.625% 18.02.25	2.625	18.02.25	USD	300 000	-	-	300 000	286 456.50	0.11
Empresa Nac 3.75% 16-05.08.26	3.750	05.08.26	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 897 203.10	0.73
Energiean Is 4.50% 21-30.03.24	4.500	30.03.24	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Entel 4.75% 14-01.08.26 /Pool	4.750	01.08.26	USD	2 300 000	-	-2 300 000	-	-	0.00
Equate Petr 4.25% 16-03.11.26	4.250	03.11.26	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Eximbank 6.125% 23-04.12.27	6.125	04.12.27	USD	-	500 000	-	500 000	495 200.00	0.19
Export Impo 3.902% 22-02.06.27	3.902	02.06.27	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Falabella	4.375	27.01.25	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Falabella 3.75% 13-30.04.23	3.750	30.04.23	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Fgb Sukuk K 3.875% 19-22.01.24	3.875	22.01.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Fibria 4% 17-14.01.25	4.000	14.01.25	USD	800 000	3 000 000	-	3 800 000	3 688 850.00	1.41
First 4.375% 23-24.04.28	4.375	24.04.28	USD	-	2 400 000	-2 400 000	-	-	0.00
First 5.125% 22-13.10.27	5.125	13.10.27	USD	-	2 500 000	-1 000 000	1 500 000	1 521 863.85	0.58
Fomento Eco 2.875% 13-10.05.23	2.875	10.05.23	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Formosa	3.375	22.04.25	USD	1 500 000	-	-750 000	750 000	719 920.44	0.28
Franshion B 4% 19-21.06.24	4.000	21.06.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Gaci First 5.0% 22-13.10.27	5.000	13.10.27	USD	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Gaz Cap 1.45% 18-06.03.23	1.450	06.03.23	CHF	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Gaz Cap 4.95% 12-19.07.22	4.950	19.07.22	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Gaz Cap 5.15% 19-11.02.26 Regs	5.150	11.02.26	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Gbl Log 3.875% 15-04.06.25	3.875	04.06.25	USD	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Geely Finan 3.0% 20-05.03.25	3.000	05.03.25	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Gf Orogen 5.125% 19-15.05.24	5.125	15.05.24	USD	-	1 750 000	-	1 750 000	1 733 293.38	0.66
Gfb 6.75% 12-30.09.22	6.750	30.09.22	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Gnl Quinter 4.634% 14-29 /Pool	4.634	31.07.29	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 116 523.87	0.43
Gohl Cap 4.25% 17-24.01.27 Regs	4.250	24.01.27	USD	2 000 000	1 000 000	-1 000 000	2 000 000	1 858 045.84	0.71
Greenko 5.50% 22-06.04.25 Regs	5.500	06.04.25	USD	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Grp Televis 4.625% 15-30.01.26	4.625	30.01.26	USD	-	3 145 000	-	3 145 000	3 065 272.27	1.17
Gruma 4.875% 14-01.12.24	4.875	01.12.24	USD	-	1 575 000	-	1 575 000	1 560 195.00	0.60
Grupo Aval	4.750	26.09.22	USD	4 920 000	-	-4 920 000	-	-	0.00
Grupo Bimbo	3.875	27.06.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Grupo Televisa 6.625% 05-18.03.25	6.625	18.03.25	USD	1 800 000	-	-1 800 000	-	-	0.00
Gs-Caltex 4.50% 22-05.01.26	4.500	05.01.26	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 906 805.42	1.11
Guatemala 4.5% 16-03.05.26	4.500	03.05.26	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 914 626.02	0.73
Hana Bank 4.375% 14-30.09.24	4.375	30.09.24	USD	-	3 500 000	-	3 500 000	3 416 467.50	1.31
Hong Kong 4.375% 23-11.01.26	4.375	11.01.26	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00

JSS Sustainable Bond - Global Short-term (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Hong Kong 4.50% 23-11.01.28	4.500	11.01.28	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Hpht Fi 2.875% 19-05.11.24	2.875	05.11.24	USD	500 000	-	-	500 000	480 542.73	0.18
Hungary 5.75% 13-22.11.23	5.750	22.11.23	USD	-	3 500 000	-2 500 000	1 000 000	1 000 403.00	0.38
Hungary 6.125% 23-22.05.28	6.125	22.05.28	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 524 850.50	0.58
Hunt 6.375% 18-01.06.28 /Pool Regs	6.375	01.06.28	USD	1 000 000	2 500 000	-2 000 000	1 500 000	1 201 200.00	0.46
Hyund Cap 1.65% 21-17.09.26	1.650	17.09.26	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Hyund Cap 2.375% 20-10.02.23	2.375	10.02.23	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Hyund Cap 2.65% 20-10.02.25	2.650	10.02.25	USD	500 000	-	-	500 000	474 065.13	0.18
Hyund Cap 2.85% 19-01.11.22	2.850	01.11.22	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Hyund Cap 5.50% 23-30.03.26	5.500	30.03.26	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	2 973 620.28	1.14
Hyund Cap 5.60% 23-30.03.28	5.600	30.03.28	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 492 619.60	0.57
Hyundai Mtr 1.75% 21-06.05.26	1.750	06.05.26	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 325 770.61	0.51
Icici Bk 3.25% 17-09.09.22 Regs	3.250	09.09.22	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Icici Bk D 4% 16-18.03.26	4.000	18.03.26	USD	300 000	2 000 000	-	2 300 000	2 200 101.18	0.84
Indian Rail 3.73% 19-29.03.24	3.730	29.03.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Indonesia 4.55% 23-11.01.28	4.550	11.01.28	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Inversiones 4.375% 13-15.05.23 Regs	4.375	15.05.23	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Inversiones 4.75% 14-15.09.24	4.750	15.09.24	USD	2 000 000	1 250 000	-	3 250 000	3 206 970.00	1.23
Itauun H Bz 2.90% 20-24.01.23	2.900	24.01.23	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Johnson Ele 4.125% 19-30.07.24	4.125	30.07.24	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	978 507.91	0.37
Jpm 3.125% 15-23.01.25	3.125	23.01.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Kalpa Gn 4.125% 17-16.08.27 Reg	4.125	16.08.27	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 869 706.40	0.72
Kazmunaygas 4.75% 19.04.27 Regs	4.750	19.04.27	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 901 310.00	0.73
Kb Kookmin 4.0% 22-09.06.25	4.000	09.06.25	USD	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Kbank Hk 3.256% 18-12.07.23 Regs	3.256	12.07.23	USD	300 000	-	-	300 000	299 838.00	0.11
Kbank Hk 5.458% 23-07.03.28	5.458	07.03.28	USD	-	500 000	-	500 000	500 537.45	0.19
Korea Exch 4.25% 14-14.10.24	4.250	14.10.24	USD	-	500 000	-	500 000	486 666.23	0.19
Korea Gas 3.875% 22-13.07.27	3.875	13.07.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Koroil 4.75% 23-03.04.26	4.750	03.04.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 962 402.88	0.75
Kr Land & H 0.625% 20-03.11.23	0.625	03.11.23	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Kr Watr Res 3.50% 22-27.04.25	3.500	27.04.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	964 127.47	0.37
Kr Xpresw 3.625% 22-18.05.25	3.625	18.05.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Kt Corp 2.625% 19-07.08.22 Regs	2.625	07.08.22	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Kt Corp 4.0% 22-08.08.25	4.000	08.08.25	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 939 410.72	0.74
Kuwait Pro	5.000	15.03.23	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Lg Chem 3.25% 19-15.10.24	3.250	15.10.24	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Li & F Ltd 4.375% 19-04.10.24	4.375	04.10.24	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Lotte P&D 4.50% 22-01.08.25	4.500	01.08.25	USD	-	1 400 000	-	1 400 000	1 364 837.59	0.52
Maf Glb 5.5% (Frn) 17-Perp Regs	5.500	31.12.99	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Maf Glb Sec 4.75% 14-07.05.24	4.750	07.05.24	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Mashreqbk 7.875% 22-24.02.33	7.875	24.02.33	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 046 326.00	0.40
Mauritius C 7.95% 23-26.04.28	7.950	26.04.28	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 066 940.00	0.79
Meglobal Can Ulc 5% 20-18.05.25	5.000	18.05.25	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Mexico Cete 5.40% 23-09.02.28	5.400	09.02.28	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 038 583.60	0.78
Mexico City 4.25% 31.10.26 Regs	4.250	31.10.26	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Millicom Ic 6.625% 18-15.10.26	6.625	15.10.26	USD	2 000 000	-	-1 000 000	1 000 000	862 451.57	0.33
Misc Cap 3.75% 22-06.04.27 Regs	3.750	06.04.27	USD	-	1 345 000	-	1 345 000	1 259 251.95	0.48
Mivivi 4.265% 22-12.04.27 Regs	4.265	12.04.27	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 450 554.69	0.56
Morocco 2.375% 20-15.12.27	2.375	15.12.27	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Morocco 5.95% 23-08.03.28 Regs	5.950	08.03.28	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 516 500.00	0.58
Multibank 7.75% 23-03.02.28	7.750	03.02.28	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Myriad Intl 4.85% 17-06.07.27 Regs	4.850	06.07.27	USD	300 000	3 200 000	-	3 500 000	3 362 940.00	1.29
Nat Kazak 3.25% 18-05.12.23	3.250	05.12.23	CHF	500 000	-	-	500 000	545 604.65	0.21
Nonghyup Bk 4.25% 22-06.07.27	4.250	06.07.27	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	969 908.68	0.37
Nova Ljubl 7.125% 23-27.06.27	7.125	27.06.27	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 665 371.13	0.64
Office Cher 5.625% 14-25.04.24	5.625	25.04.24	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 492 385.00	0.95
Otp Bank 7.50% 23-25.05.27	7.500	25.05.27	USD	-	2 500 000	-	2 500 000	2 501 775.00	0.96
Panama 8.875% 97-30.09.27	8.875	30.09.27	USD	-	2 426 000	-	2 426 000	2 789 811.94	1.07
Paraguay 5% 16-15.04.26	5.000	15.04.26	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00

JSS Sustainable Bond - Global Short-term (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Pccw Hkt Cap N5 3.75% 13-08.03.23	3.750	08.03.23	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Per Pe Sbsn 4.40% 22-06.06.27	4.400	06.06.27	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	985 371.63	0.38
Pertamina 1.40% 21-09.02.26	1.400	09.02.26	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 809 216.58	0.69
Peru 7.35% 05-21.07.25	7.350	21.07.25	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Perus Gas	5.125	16.05.24	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Philippine 5.17% 22-13.10.27	5.170	13.10.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Philippne N 3.28% 19-27.09.24	3.280	27.09.24	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 453 424.10	0.56
Phosagro Bd 3.05% 20-23.01.25	3.050	23.01.25	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Pko Bank 5.625% 23-01.02.26	5.625	01.02.26	EUR	-	1 200 000	-	1 200 000	1 312 930.43	0.50
Pko Fin 4.63% 12-26.09.22 Regs	4.630	26.09.22	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Posco 4.375% 22-04.08.25	4.375	04.08.25	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Pttep Treas 2.587% 20-10.06.27	2.587	10.06.27	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Qib Sukuk L 3.982% 19-26.03.24	3.982	26.03.24	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Qnb Fin 1.375% 21-26.01.26	1.375	26.01.26	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Qnb Fin 3.5% 19-28.03.24	3.500	28.03.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Qtel Int Fi	3.250	21.02.23	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Qtel Int Fi 5% 10-19.10.25 Reg-S	5.000	19.10.25	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 501 914.00	0.57
Raiffeisenb 7.125% 23-19.01.26	7.125	19.01.26	EUR	-	1 700 000	-	1 700 000	1 850 706.83	0.71
Rakfunding 4.125% 19-09.04.24	4.125	09.04.24	USD	500 000	1 800 000	-	2 300 000	2 272 533.40	0.87
Ras Laff 3 5.838% 30.09.27 /Pool	5.838	30.09.27	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Rasga 6.332% 30.09.27 /Pool Regs	6.332	30.09.27	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Rec Ltd 5.25% 18-13.11.23	5.250	13.11.23	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 987 910.00	1.14
Reliance In	4.125	28.01.25	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 950 134.08	0.75
Rizal Commer Bk 3% 19-11.09.24	3.000	11.09.24	USD	800 000	700 000	-	1 500 000	1 447 763.58	0.55
Romania 2.875% 14-28.10.24	2.875	28.10.24	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Romania 4.875% 14-22.01.24	4.875	22.01.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Romania 5.0% 22-27.09.26	5.000	27.09.26	EUR	-	2 500 000	-	2 500 000	2 743 264.95	1.05
Rural Elec 3.375% 19-25.07.24	3.375	25.07.24	USD	500 000	-	-	500 000	485 623.25	0.19
Rural Elec 5.625% 23-11.04.28	5.625	11.04.28	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 484 152.43	0.57
Sa Global S 0.946% 17.06.24 Regs	0.946	17.06.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Safra 4.125% 18-08.02.23	4.125	08.02.23	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Santander	4.125	09.11.22	USD	2 300 000	-	-2 300 000	-	-	0.00
Santander 5.375% 20-17.04.25 Regs	5.375	17.04.25	USD	2 000 000	1 000 000	-	3 000 000	2 969 447.40	1.14
Saudi Elec	4.000	08.04.24	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Saudi Elec 4.22% 27.01.24 Regs	4.220	27.01.24	USD	2 435 000	-	-2 435 000	-	-	0.00
Sb Capital 5.25% 13-23.05.23	5.250	23.05.23	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	50 000.00	0.02
Scotiabk Peru 4.5% (Frn) 13.12.27	4.500	13.12.27	USD	300 000	2 500 000	-2 800 000	-	-	0.00
Shinhan Bk 3.875% 16-24.03.26	3.875	24.03.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 880 464.96	0.72
Shriram 4.40% 21-13.03.24	4.400	13.03.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Siam Comm 3.9% 19-11.02.24	3.900	11.02.24	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Sibur Sec L 2.95% 20-08.07.25	2.950	08.07.25	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Sigma 2.625% 17-07.02.24 Regs	2.625	07.02.24	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	2 156 819.72	0.83
Sigma 4.125% 16-02.05.26	4.125	02.05.26	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	954 503.91	0.37
Sk Brdband 3.875% 18-13.08.23	3.875	13.08.23	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Sk Hynix 1.0% 21-19.01.24	1.000	19.01.24	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Sk Hynix 6.25% 23-17.01.26	6.250	17.01.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 000 967.20	0.77
Sk On Co Lt 5.375% 23-11.05.26	5.375	11.05.26	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	992 051.10	0.38
South Afr 4.85% 17-27.09.27	4.850	27.09.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
South Africa 4.665% 12-17.01.24	4.665	17.01.24	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 487 250.00	0.57
Spdb Hk Frn 20-27.07.23	0.000	27.07.23	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	1 000 090.00	0.38
St Bk India 1.80% 21-13.07.26	1.800	13.07.26	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
St Bk India 4.375% 24.01.24 Regs	4.375	24.01.24	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 973 000.00	1.14
St Bk India 4.875% 23-05.05.28	4.875	05.05.28	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	980 711.19	0.38
St Marys 5.75% 16-28.01.27	5.750	28.01.27	USD	-	2 204 000	-	2 204 000	2 209 761.26	0.85
Std Chart 6.17% 23-09.01.27	6.170	09.01.27	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	2 997 875.46	1.15
Std Chart 7.776% 22-16.11.25	7.776	16.11.25	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	3 069 574.50	1.17
Suam Fin 4.875% 14-17.04.24	4.875	17.04.24	USD	800 000	1 200 000	-	2 000 000	1 976 840.80	0.76
Sunshine 4.5% 16-20.04.26	4.500	20.04.26	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Susano Aust 5.75% 16-14.07.26	5.750	14.07.26	USD	300 000	-	-	300 000	300 224.94	0.11

JSS Sustainable Bond - Global Short-term (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Swire Pac 3.875% 15-21.09.25	3.875	21.09.25	USD	-	1 700 000	-	1 700 000	1 635 294.28	0.63
Swire Pac 4.5% 13-09.10.23	4.500	09.10.23	USD	500 000	-	-	500 000	498 357.98	0.19
Tencent Hol 1.81% 20-26.01.26	1.810	26.01.26	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 366 077.44	0.52
Tencent Mus 1.375% 20-03.09.25	1.375	03.09.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Thaioil 3.625% 18-23.01.23 Regs	3.625	23.01.23	USD	3 500 000	-	-3 500 000	-	-	0.00
Tower B Inf 2.75% 21-20.01.26	2.750	20.01.26	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 380 022.65	0.53
Tower B Inf 4.25% 20-21.01.25	4.250	21.01.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	979 702.78	0.37
Trinidad & 4.375% 13-16.01.24	4.375	16.01.24	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 978 290.00	0.76
Trust F 5.25% 14-15.12.24 Regs	5.250	15.12.24	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 934 600.00	1.12
Tsmc 3.875% 22-22.04.27 144A	3.875	22.04.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Union Natio 4% 18-13.03.23	4.000	13.03.23	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Usa 4.50% 22-30.11.24 /Tbo	4.500	30.11.24	USD	-	10 000 000	-10 000 000	-	-	0.00
Vietnam 4.8% 14-19.11.24	4.800	19.11.24	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 459 973.10	0.94
Weibo 3.5% 19-05.07.24	3.500	05.07.24	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 952 280.00	0.75
Woori Bk	4.750	30.04.24	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 956 649.73	1.13
								215 284 881.71	82.42
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								215 284 881.71	82.42

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Abq Finance 1.875% 20-08.09.25	1.875	08.09.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 846 778.00	0.71
Abq Finance 3.125% 19-24.09.24	3.125	24.09.24	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 451 416.50	0.56
Adcb 4.50% 22-14.09.27	4.500	14.09.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Arauco	4.500	01.08.24	USD	2 000 000	1 000 000	-	3 000 000	2 950 830.00	1.13
Arauco 3.875% 18-02.11.27	3.875	02.11.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Azure Orbit 3.75% 18-25.01.23	3.750	25.01.23	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Banco Peru 3.375% 18-18.01.23	3.375	18.01.23	USD	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Banco Voto 4% 19-24.09.22	4.000	24.09.22	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Bangkok Bk 4.30% 22-15.06.27	4.300	15.06.27	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 458 563.04	0.56
Banistmo 4.25% 20-31.07.27	4.250	31.07.27	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Bco Con Sae 2.75% 20-10.12.25 Regs	2.750	10.12.25	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	902 165.00	0.35
Bco Dest Cl 2.704% 20-09.01.25	2.704	09.01.25	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 914 533.02	0.73
Bdo Unibank 2.125% 20-13.01.26	2.125	13.01.26	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 379 705.91	0.53
Bk Cn Macau Frn 19-17.10.22 Regs	0.000	17.10.22	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Bk Cn Macau Frn 22-28.04.25	0.000	28.04.25	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	3 003 900.00	1.15
Bk Leumi 5.125% 22-27.07.27	5.125	27.07.27	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 988 768.00	0.76
Boc Aviatio 3.25% 20-29.04.25 Regs	3.250	29.04.25	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 854 816.35	1.09
Boc Hk Frn 20-24.06.23	0.000	24.06.23	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Bocom Leasi Frn 20-02.03.25	0.000	02.03.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	995 405.00	0.38
Bsf Financ 5.50% 23.11.27 Regs	5.500	23.11.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Ccbl 1.99% 20-21.07.25	1.990	21.07.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 844 812.42	0.71
Cdbl Fundin 1.50% 20-04.11.23	1.500	04.11.23	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Cicc Hk Fin Frn 20-18.02.23	0.000	18.02.23	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Cnpc Global 1.125% 20-23.06.23	1.125	23.06.23	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Credicorp 2.75% 20-17.06.25 Regs	2.750	17.06.25	USD	500 000	1 500 000	-	2 000 000	1 890 637.54	0.72
Dib Sukuk 1.959% 21-22.06.26	1.959	22.06.26	USD	4 000 000	-	-4 000 000	-	-	0.00
Eib Sukuk 2.082% 21-02.11.26	2.082	02.11.26	USD	750 000	-	-750 000	-	-	0.00
Falabella 3.75% 17-30.10.27	3.750	30.10.27	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Far East Ho 3.375% 20-18.02.25	3.375	18.02.25	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Fgb Sukuk K 2.50% 20-21.01.25	2.500	21.01.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Geely Auto 3.625% 18-25.01.23	3.625	25.01.23	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Hcl America 1.375% 21-10.03.26	1.375	10.03.26	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Hdfc Bk 5.686% 23-02.03.26	5.686	02.03.26	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	2 994 370.11	1.15
Huarong Frn 20-24.02.23	0.000	24.02.23	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Hyund Cap 5.80% 23-26.06.25	5.800	26.06.25	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 996 574.32	0.76
Icbc Hk 1.0% 20-20.07.23	1.000	20.07.23	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Indbk Korea Frn 19-23.10.22	0.000	23.10.22	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00

JSS Sustainable Bond - Global Short-term (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Israel Dis 5.375% 23-26.01.28	5.375	26.01.28	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 483 836.00	0.57
Korea Gas 4.875% 23-05.07.28	4.875	05.07.28	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 493 258.39	0.57
Korearehabn 4.125% 22-20.04.27	4.125	20.04.27	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 834 688.00	1.08
Kt Corp 1.0% 20-01.09.25	1.000	01.09.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Maf Sukuk	4.500	03.11.25	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Mirae Asset 2.125% 20-30.07.23	2.125	30.07.23	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Misc Cap Two 3.625% 22-06.04.25	3.625	06.04.25	USD	1 700 000	-	-	1 700 000	1 635 012.76	0.63
Nbm Us Hold 7% 19-14.05.26 Regs	7.000	14.05.26	USD	2 000 000	1 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Nonghyup Bk 4.0% 22-06.01.26	4.000	06.01.26	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Posco 2.375% 19-12.11.22	2.375	12.11.22	USD	350 000	-	-350 000	-	-	0.00
Posco 2.375% 20-17.01.23	2.375	17.01.23	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Qib Sukuk Frn 20-07.02.25	0.000	07.02.25	USD	1 300 000	-	-	1 300 000	1 314 397.50	0.50
Rural Elec 2.25% 21-01.09.26	2.250	01.09.26	USD	800 000	1 200 000	-2 000 000	-	-	0.00
Sd Hi-Sp Gr 2.437% 20-19.11.23	2.437	19.11.23	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Shanghai EI 2.30% 20-21.02.25	2.300	21.02.25	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Shinhan Bk Frn 20-24.04.25 Regs	0.000	24.04.25	USD	200 000	-	-	200 000	203 096.48	0.08
Sibur Sec L 3.45% 19-23.09.24	3.450	23.09.24	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Sk Telecom 6.625% 07-20.07.27	6.625	20.07.27	USD	-	1 560 000	-	1 560 000	1 648 581.48	0.63
Std Chart Frn 23-06.07.27	0.000	06.07.27	USD	-	3 500 000	-	3 500 000	3 519 665.10	1.35
Telekom Malay. 7.875% 95-25 Reg.S	7.875	01.08.25	USD	-	700 000	-700 000	-	-	0.00
Transelec 4.625% 13-26.07.23	4.625	26.07.23	USD	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Vena Energy 3.133% 20-26.02.25	3.133	26.02.25	USD	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Vivo Energy 5.125% 20-24.09.27	5.125	24.09.27	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Warba Sukuk 2.982% 19-24.09.24	2.982	24.09.24	USD	500 000	-	-	500 000	484 167.00	0.18
Wharf Reic 2.375% 20-07.05.25	2.375	07.05.25	USD	1 300 000	-	-	1 300 000	1 222 657.03	0.47
								45 312 634.95	17.35
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								45 312 634.95	17.35
SUMME WERTPAPIERBESTAND								260 597 516.66	99.77
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								2 075 915.19	0.79
Sonstige Passiven								-1 479 071.67	-0.56
GESAMTNETTOVERMÖGEN								261 194 360.18	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond CHF

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in CHF	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
Aadb 0.375% 18-23.01.23	0.375	23.01.23	CHF	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Aadb Ky 0.50% 19-29.11.24	0.500	29.11.24	CHF	300 000	-	-	300 000	291 630.00	1.41
Afd 2.625% 12-18.02.25	2.625	18.02.25	CHF	300 000	-	-	300 000	303 825.00	1.47
Akademiska 0.3% 17-08.10.29	0.300	08.10.29	CHF	200 000	-	-	200 000	182 800.00	0.88
Akademiska 0.65% 18-08.02.44	0.650	08.02.44	CHF	300 000	-	-	300 000	242 850.00	1.17
Akademiska 1.992% 23-14.03.33	1.992	14.03.33	CHF	-	150 000	-	150 000	153 487.50	0.74
Amgen	0.410	08.03.23	CHF	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Apple Inc	0.375	25.11.24	CHF	350 000	-	-150 000	200 000	195 990.00	0.95
At&T Inc 1.375% 14-04.12.24	1.375	04.12.24	CHF	500 000	-	-	500 000	495 325.00	2.39
Auchan	1.500	03.06.24	CHF	500 000	-	-	500 000	493 450.00	2.38
Banort 1.55% 19-11.10.22	1.550	11.10.22	CHF	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Bawag Psk 2.052% 23-14.04.28	2.052	14.04.28	CHF	-	200 000	-	200 000	199 049.93	0.96
Bc Sant Cl 0.33% 21-22.06.27	0.330	22.06.27	CHF	200 000	-	-	200 000	180 000.00	0.87
Bco Chile 0.575% 17-07.04.27	0.575	07.04.27	CHF	300 000	-	-	300 000	273 825.00	1.32
Bei 3.125% 06-30.06.36	3.125	30.06.36	CHF	400 000	-	-	400 000	477 400.00	2.30
Bfcm 1.50% 22-01.06.27	1.500	01.06.27	CHF	300 000	-	-	300 000	288 750.00	1.39
Bk Scotia 0.278% 22-01.04.27	0.278	01.04.27	CHF	200 000	-	-	200 000	188 000.00	0.91
Bk Scotia 0.385% 22-01.02.29	0.385	01.02.29	CHF	200 000	-	-	200 000	178 950.00	0.86
Black Sea T 0.35% 21-15.03.27	0.350	15.03.27	CHF	300 000	-	-	300 000	257 400.00	1.24
Bnp Par 2.412% 23-13.01.28	2.412	13.01.28	CHF	-	200 000	-	200 000	199 500.00	0.96
Cabei 0.17% 21-29.09.31	0.170	29.09.31	CHF	300 000	-	-	300 000	253 650.00	1.22
Cbq Finance 0.735% 20-27.11.24	0.735	27.11.24	CHF	400 000	-	-	400 000	390 780.00	1.89
Cellnex Tel 0.775% 20-18.02.27	0.775	18.02.27	CHF	500 000	-	-	500 000	466 500.00	2.25
Cff	2.500	24.02.31	CHF	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Co Fin 1.903% 23-16.06.28	1.903	16.06.28	CHF	-	200 000	-	200 000	200 150.00	0.97
Corp Andina 0.45% 22-24.02.27	0.450	24.02.27	CHF	200 000	-	-	200 000	187 050.00	0.90
Corp Andina 0.70% 20-04.09.25	0.700	04.09.25	CHF	300 000	-	-	300 000	289 950.00	1.40
Corp Andina 2.428% 23-15.02.30	2.428	15.02.30	CHF	-	200 000	-	200 000	200 980.00	0.97
Cred Agric 3.042% 22-29.09.27	3.042	29.09.27	CHF	-	200 000	-	200 000	203 450.00	0.98
Credito 0.599% 22-26.04.27	0.599	26.04.27	CHF	300 000	-	-	300 000	272 700.00	1.32
Deutsch Bah 0.5% 18-18.07.28	0.500	18.07.28	CHF	300 000	-	-	300 000	282 150.00	1.36
Dh Switzerl 0.5% 15-08.12.23	0.500	08.12.23	CHF	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Dnb Bank As 1.168% 22-03.06.27	1.168	03.06.27	CHF	200 000	-	-	200 000	191 750.00	0.93
Dt Bahn Fin 2.285% 22-28.11.42	2.285	28.11.42	CHF	-	400 000	-	400 000	432 900.00	2.09
Dz Bk Zentr 2.625% 23-27.08.29	2.625	27.08.29	CHF	-	200 000	-	200 000	199 259.99	0.96
Ebn	1.125	04.07.24	CHF	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Ebn	0.875	22.09.26	CHF	250 000	-	-	250 000	242 937.50	1.17
Eib	1.500	02.08.24	CHF	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Eli Lilly	0.150	24.05.24	CHF	400 000	-	-200 000	200 000	197 080.00	0.95
Eli Lilly	0.450	24.05.28	CHF	250 000	-	-	250 000	234 562.50	1.13
Erste Bk 0.25% 21-02.10.28	0.250	02.10.28	CHF	200 000	-	-	200 000	177 350.00	0.86
First 0.205% 19-04.12.25	0.205	04.12.25	CHF	300 000	-	-	300 000	285 225.00	1.38
Heathrow Fd 1.80% 22-27.05.27	1.800	27.05.27	CHF	200 000	-	-	200 000	195 450.00	0.94
Hypo Noe Gr 0.10% 19-27.11.24	0.100	27.11.24	CHF	200 000	-	-	200 000	193 970.00	0.94
Ico	3.250	28.06.24	CHF	500 000	-	-	500 000	505 650.00	2.44
Itau Bba In 0.56% 22-17.02.25	0.560	17.02.25	CHF	200 000	-	-	200 000	193 600.00	0.93
Jackson Nat 0.125% 20-14.07.28	0.125	14.07.28	CHF	-	200 000	-	200 000	174 400.00	0.84
Kfw	2.500	25.08.25	CHF	500 000	-	-200 000	300 000	306 075.00	1.48
Kfw 2.75% 07-16.02.37	2.750	16.02.37	CHF	100 000	-	-	100 000	115 325.00	0.56
Kommkrdt	2.875	13.10.31	CHF	300 000	-	-	300 000	329 625.00	1.59
Kommunalbk 1.275% 22-22.12.27	1.275	22.12.27	CHF	-	200 000	-	200 000	196 500.00	0.95
Kr Hous Fin 2.465% 22-14.10.27	2.465	14.10.27	CHF	-	200 000	-	200 000	202 500.00	0.98
Macquarie G 0.395% 21-20.07.28	0.395	20.07.28	CHF	300 000	-	-	300 000	270 075.00	1.30
Munhyp 0.25% 19-10.05.30	0.250	10.05.30	CHF	400 000	-	-	400 000	359 000.00	1.73

JSS Sustainable Bond CHF (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in CHF	% des Netto- vermögens
Munhyp 0.35% 18-12.12.23	0.350	12.12.23	CHF	400 000	-	-	400 000	396 850.00	1.92
Munhyp 0.55% 19-15.03.34	0.550	15.03.34	CHF	200 000	-	-	200 000	175 400.00	0.85
Muni Fin	1.375	08.06.27	CHF	300 000	-	-	300 000	296 625.00	1.43
Nat Bui Soc 1.520% 22-17.12.29	1.520	17.12.29	CHF	-	200 000	-	200 000	194 950.00	0.94
Natl Bk 1.958% 22-03.11.27	1.958	03.11.27	CHF	-	200 000	-	200 000	200 200.00	0.97
Natwest Mar 0.898% 22-04.04.25	0.898	04.04.25	CHF	200 000	-	-	200 000	195 400.00	0.94
Nbaduh 0.3225% 18-27.09.23	0.322	27.09.23	CHF	600 000	-	-200 000	400 000	398 420.00	1.92
Nordea Bank 1.81% 22-15.06.27	1.810	15.06.27	CHF	200 000	-	-	200 000	195 600.00	0.94
North Am 0.55% 20-27.05.33	0.550	27.05.33	CHF	300 000	-	-	300 000	266 400.00	1.29
Nth Rhine-W	0.875	29.07.24	CHF	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Nwb 0.235% 22-14.04.27	0.235	14.04.27	CHF	200 000	-	-	200 000	189 750.00	0.92
Oekb	2.875	25.02.30	CHF	300 000	-	-	300 000	324 525.00	1.57
Rbc 0.20% 21-22.09.31	0.200	22.09.31	CHF	200 000	-	-	200 000	167 200.00	0.81
Rbc 0.40% 22-05.10.26	0.400	05.10.26	CHF	200 000	-	-	200 000	190 500.00	0.92
Rbc 2.085% 23-31.03.28	2.085	31.03.28	CHF	-	200 000	-	200 000	201 650.00	0.97
Shb 1.25% 22-24.05.27	1.250	24.05.27	CHF	200 000	-	-	200 000	192 900.00	0.93
Socgen 2.618% 23-27.02.30	2.618	27.02.30	CHF	-	200 000	-	200 000	200 550.00	0.97
Spbk 1 0.125% 19-11.12.25	0.125	11.12.25	CHF	300 000	-	-	300 000	284 475.00	1.37
Spbk Bolikr 0.508% 22-06.04.27	0.508	06.04.27	CHF	200 000	-	-	200 000	189 650.00	0.92
Transurban 0.875% 21-19.11.31	0.875	19.11.31	CHF	400 000	-	-	400 000	359 600.00	1.74
Ubs Ag Lond 2.33% 22-14.11.25	2.330	14.11.25	CHF	-	200 000	-	200 000	199 900.00	0.96
Unibail Rod	2.000	20.11.23	CHF	500 000	-	-	500 000	498 745.00	2.41
Verizon 0.375% 31.05.23 Regs	0.375	31.05.23	CHF	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Verizon Com 1% 17-30.11.27	1.000	30.11.27	CHF	200 000	-	-	200 000	191 250.00	0.92
Vodafone 0.375% 16-03.12.24	0.375	03.12.24	CHF	200 000	-	-	200 000	195 480.00	0.94
Westpac Bk 1.802% 22-21.09.29	1.802	21.09.29	CHF	-	200 000	-	200 000	198 750.00	0.96
Wplau	1.000	11.12.23	CHF	500 000	-	-	500 000	496 900.00	2.40
								18 754 497.42	90.52
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								18 754 497.42	90.52
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden									
Anleihen									
Abn Amro Ba 2.505% 23-26.06.28	2.505	26.06.28	CHF	-	200 000	-	200 000	200 700.00	0.97
Cibc 0.18% 21-20.04.29	0.180	20.04.29	CHF	200 000	-	-	200 000	175 400.00	0.85
Cibc 0.282% 22-03.02.27	0.282	03.02.27	CHF	200 000	-	-	200 000	185 350.00	0.89
Engie 2.49% 23-04.07.31	2.490	04.07.31	CHF	-	200 000	-	200 000	202 616.24	0.98
Lloyds Bk 0.6025% 22-09.02.29	0.603	09.02.29	CHF	200 000	-	-	200 000	178 100.00	0.86
								942 166.24	4.55
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								942 166.24	4.55

JSS Sustainable Bond CHF (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in CHF	% des Netto- vermögens
Sonstige übertragbare Wertpapiere									
Anleihen									
Bqe Postale 2.828% 23-12.07.30	2.828	12.07.30	CHF	-	200 000	-	200 000	201 714.20	0.97
Comwith Ny 1.94% 23-26.06.30	1.940	26.06.30	CHF	-	300 000	-	300 000	301 200.00	1.46
							502 914.20	2.43	
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere								502 914.20	2.43
SUMME WERTPAPIERBESTAND								20 398 727.86	98.46
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								513 637.14	2.48
Sonstige Passiven								-194 967.63	-0.94
GESAMTNETTOVERMÖGEN								20 717 397.37	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Euro Broad

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
A2A 0.625% 21-15.07.31	0.625	15.07.31	EUR	-	800 000	-	800 000	599 747.20	0.51
Aareal Bk 4.50% 22-25.07.25	4.500	25.07.25	EUR	-	300 000	-	300 000	291 255.00	0.25
Abb Fin Bv 3.375% 23-16.01.31	3.375	16.01.31	EUR	-	200 000	-	200 000	196 320.80	0.17
Abbott II F 0.375% 19-19.11.27	0.375	19.11.27	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	876 587.98	0.74
Achmea Bv 4.25% 15-Perp	4.250	31.12.99	EUR	-	500 000	-	500 000	486 610.00	0.41
Achmea Bv 6% 13-04.04.43	6.000	04.04.43	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Adidas 3.125% 22-21.11.29 Regs	3.125	21.11.29	EUR	-	100 000	-	100 000	98 083.40	0.08
Adif Alta V 0.55% 20-30.04.30	0.550	30.04.30	EUR	1 100 000	200 000	-	1 300 000	1 058 032.30	0.90
Adif Alta V 0.95% 19-30.04.27	0.950	30.04.27	EUR	1 800 000	100 000	-400 000	1 500 000	1 360 270.50	1.15
Aegon Nv Frn	0.000	31.12.99	EUR	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Allianz 4.252% 22-05.07.52	4.252	05.07.52	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Alpha Bank 6.875% 23-27.06.29	6.875	27.06.29	EUR	-	500 000	-	500 000	497 827.50	0.42
Apple Inc 1.375% 17-24.05.29	1.375	24.05.29	EUR	-	300 000	-	300 000	269 760.30	0.23
Assgen 2.429% 20-14.07.31	2.429	14.07.31	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Athora Hold 6.625% 23-16.06.28	6.625	16.06.28	EUR	-	700 000	-	700 000	694 117.20	0.59
Atradius Fi 5.25% 14-23.09.44	5.250	23.09.44	EUR	-	500 000	-400 000	100 000	98 217.30	0.08
Auckland Co 0.25% 21-17.11.31	0.250	17.11.31	EUR	2 800 000	-	-	2 800 000	2 172 352.00	1.84
Austria 2.1% 17-20.09.2117	2.100	20.09.17	EUR	-	2 500 000	-	2 500 000	1 844 940.00	1.56
Axa Frn 04-Perp	0.000	31.12.99	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Banc Ifis 4.5% 17-17.10.27 Regs	4.500	17.10.27	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Banco Bilba 1.375% 18-14.05.25	1.375	14.05.25	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Banco Cred 1.75% 21-09.03.28	1.750	09.03.28	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Banco Cred 8.0% 22-22.09.26	8.000	22.09.26	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Bauspark Wu 4.125% 17-27.10.27	4.125	27.10.27	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Bayer Landk 1.875% 22-02.06.42	1.875	02.06.42	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Bayern 0.01% 20-18.01.35	0.010	18.01.35	EUR	2 500 000	-	-	2 500 000	1 771 527.50	1.50
Bbva 6.0% 20-Perp	6.000	31.12.99	EUR	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Bco Sab 0.875% 21-16.06.28	0.875	16.06.28	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Bco Sab 5.125% 22-10.11.28	5.125	10.11.28	EUR	-	200 000	-	200 000	201 786.10	0.17
Bco Sab 6.00% 23-16.08.33 Regs	6.000	16.08.33	EUR	-	200 000	-	200 000	184 914.80	0.16
Belfius Bk 3.625% 18-Perp	3.625	31.12.99	EUR	400 000	1 200 000	-1 600 000	-	-	0.00
Belfius Bk 3.875% 23-12.06.28	3.875	12.06.28	EUR	-	400 000	-	400 000	396 676.33	0.34
Belfius Bk 5.25% 23-19.04.33	5.250	19.04.33	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Belgium 1.40% 22-22.06.53	1.400	22.06.53	EUR	-	2 500 000	-	2 500 000	1 594 717.50	1.35
Berlin 2.75% 23-14.02.33	2.750	14.02.33	EUR	-	400 000	-	400 000	392 413.20	0.33
Bfcm 0.01% 21-07.03.25	0.010	07.03.25	EUR	500 000	-	-	500 000	465 601.50	0.39
Bfcm 2.625% 22-06.11.29	2.625	06.11.29	EUR	500 000	-	-	500 000	450 377.00	0.38
Bfcm 3.875% 22-16.06.32	3.875	16.06.32	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Bmw Fin 3.25% 23-22.07.30	3.250	22.07.30	EUR	-	400 000	-	400 000	393 034.00	0.33
Bng 0.875% 19-17.10.35	0.875	17.10.35	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	1 543 714.00	1.31
Bpce Sfh 1.75% 22-27.05.32	1.750	27.05.32	EUR	600 000	-	-	600 000	528 409.20	0.45
Bqe Postale 0.75% 21-02.08.32	0.750	02.08.32	EUR	-	400 000	-	400 000	323 279.20	0.27
Bqe Postale 3.0% 21-Perp	3.000	31.12.99	EUR	-	1 200 000	-1 200 000	-	-	0.00
Bqe Postale 4.375% 23-17.01.30	4.375	17.01.30	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Brenntag 0.50% 21-06.10.29	0.500	06.10.29	EUR	-	100 000	-	100 000	80 204.10	0.07
Btpps 1.65% 15-01.03.32 /Btp	1.650	01.03.32	EUR	750 000	1 000 000	-1 750 000	-	-	0.00
By Lbk 1.0% 21-23.09.31	1.000	23.09.31	EUR	-	600 000	-	600 000	491 992.52	0.42
By Lbk 3.75% 23-07.02.29	3.750	07.02.29	EUR	-	100 000	-	100 000	96 646.57	0.08
By Lbk 4.25% 23-21.06.27	4.250	21.06.27	EUR	-	300 000	-	300 000	298 572.30	0.25
Caixabank 1.25% 21-18.06.31	1.250	18.06.31	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Caixabank 3.625% 21-Perp	3.625	31.12.99	EUR	-	2 200 000	-2 200 000	-	-	0.00
Carmila 1.625% 21-01.04.29	1.625	01.04.29	EUR	800 000	500 000	-1 300 000	-	-	0.00
Cassa Depo 1.0% 20-11.02.30	1.000	11.02.30	EUR	3 000 000	-	-	3 000 000	2 456 007.00	2.08
Cassa Depo 1.0% 20-21.09.28	1.000	21.09.28	EUR	2 800 000	-	-	2 800 000	2 396 458.40	2.03

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Cattol Ass 4.25% 17-14.12.47	4.250	14.12.47	EUR	600 000	-	-300 000	300 000	288 769.05	0.24
Cnp Assuran 1.25% 27.01.29 Regs	1.250	27.01.29	EUR	-	300 000	-200 000	100 000	82 813.02	0.07
Cnp Assuran 2% 19-27.07.50	2.000	27.07.50	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Co Fin 0.50% 22-16.03.28	0.500	16.03.28	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	1 744 948.00	1.48
Co Fin 2.375% 22-15.03.30	2.375	15.03.30	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	943 937.76	0.80
Coca Cola 0.375% 20-15.03.33	0.375	15.03.33	EUR	-	100 000	-	100 000	74 577.19	0.06
Com.Di Milano 4.019% 05-29.06.35	4.019	29.06.35	EUR	1 500 000	1 000 000	-	2 500 000	2 393 778.33	2.03
Comcast 0.75% 20-20.02.32	0.750	20.02.32	EUR	500 000	-	-200 000	300 000	236 093.10	0.20
Comzbk 6.125% 20-Perp	6.125	31.12.99	EUR	-	4 200 000	-4 200 000	-	-	0.00
Continental 3.625% 22-30.11.27	3.625	30.11.27	EUR	-	100 000	-	100 000	98 858.20	0.08
Cppib Capit 0.875% 19-06.02.29	0.875	06.02.29	EUR	2 500 000	750 000	-	3 250 000	2 834 094.25	2.40
Cred Agric 4.125% 07.03.30 Regs	4.125	07.03.30	EUR	-	300 000	-	300 000	303 613.50	0.26
Dbj 3.125% 23-13.04.28	3.125	13.04.28	EUR	-	200 000	-	200 000	196 835.40	0.17
De Volksban 7.0% 22-Perp	7.000	31.12.99	EUR	700 000	1 000 000	-1 700 000	-	-	0.00
Delta Lloyd	4.375	31.12.99	EUR	450 000	700 000	-999 000	151 000	149 007.25	0.13
Deut Kredbk 0.01% 21-23.02.26	0.010	23.02.26	EUR	1 000 000	-	-35 000	965 000	863 094.07	0.73
Deut Tel If 1.125% 17-22.05.26	1.125	22.05.26	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Deutschlan 0.10% 15.04.33 /Infl	0.100	15.04.33	EUR	-	6 500 000	-6 500 000	-	-	0.00
Deutschland 0% 22.02.23 Tb	0.000	22.02.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Deutschland 0.0% 20-15.08.50	0.000	15.08.50	EUR	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Deutschland 0.0% 21-15.08.52	0.000	15.08.52	EUR	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Diageo Cap 0.125% 20-28.09.28	0.125	28.09.28	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	844 795.01	0.72
Dt Gen Hyp 3.0% 23-30.11.32	3.000	30.11.32	EUR	-	200 000	-	200 000	197 586.20	0.17
E.On 0.375% 20-29.09.27	0.375	29.09.27	EUR	-	100 000	-	100 000	87 813.20	0.07
E.On 1.625% 22-29.03.31	1.625	29.03.31	EUR	500 000	-	-	500 000	434 203.50	0.37
Edp 3.875% 23-26.06.28	3.875	26.06.28	EUR	-	100 000	-	100 000	99 867.90	0.08
Eib 1.5% 17-15.11.47	1.500	15.11.47	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	719 445.00	0.61
Eli Lilly 0.625% 19-01.11.31	0.625	01.11.31	EUR	-	100 000	-	100 000	79 989.10	0.07
Elia Group 5.85% 23-Perp	5.850	31.12.99	EUR	-	100 000	-	100 000	100 559.90	0.09
Elm Bv 3.375% 17-29.09.47 Regs	3.375	29.09.47	EUR	-	400 000	-	400 000	361 286.00	0.31
Enel 6.375% 23-Perp Regs	6.375	31.12.99	EUR	-	100 000	-100 000	-	-	0.00
Enel Fin 1% 17-16.09.24	1.000	16.09.24	EUR	-	200 000	-	200 000	192 938.00	0.16
Enexis 0.75% 19-02.07.31 Regs	0.750	02.07.31	EUR	400 000	-	-	400 000	323 544.00	0.27
Enexis 3.625% 23-12.06.34	3.625	12.06.34	EUR	-	100 000	-	100 000	100 367.10	0.09
Eq 2.875% 22-06.04.32	2.875	06.04.32	EUR	400 000	-	-	400 000	319 336.56	0.27
Ericsson 1.125% 22-08.02.27	1.125	08.02.27	EUR	1 700 000	-	-1 600 000	100 000	88 293.40	0.07
Erste Bk 4.0% 23-16.01.31	4.000	16.01.31	EUR	-	200 000	-	200 000	196 651.60	0.17
Esb Fin 1.125% 19-11.06.30	1.125	11.06.30	EUR	-	100 000	-	100 000	85 240.80	0.07
Eu 0.0% 21-02.06.28	0.000	02.06.28	EUR	-	4 000 000	-	4 000 000	3 441 000.00	2.91
Eu 0.0% 21-04.03.26	0.000	04.03.26	EUR	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Eu 0.40% 21-04.02.37	0.400	04.02.37	EUR	-	1 200 000	-	1 200 000	840 351.60	0.71
Eurofima 0.15% 19-10.10.34	0.150	10.10.34	EUR	-	600 000	-	600 000	430 654.20	0.36
Eurogrid 3.279% 22-05.09.31	3.279	05.09.31	EUR	-	100 000	-	100 000	97 087.62	0.08
Fonciere Re 1.875% 16-20.05.26	1.875	20.05.26	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Fondiarria 5.75% 14-Perp	5.750	31.12.99	EUR	750 000	950 000	-300 000	1 400 000	1 386 350.00	1.17
France 0.1% 21-25.07.38 /Infl	0.100	25.07.38	EUR	3 300 000	1 000 000	-4 300 000	-	-	0.00
France O.A. 0.10% 25.07.53 /Infl	0.100	25.07.53	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
France O.A. 0.75% 21-25.05.53	0.750	25.05.53	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	532 359.00	0.45
France O.A. 3.0% 22-25.05.54 /Oat	3.000	25.05.54	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Generali Fi 4.596% 14-Perp Regs	4.596	31.12.99	EUR	850 000	650 000	-1 400 000	100 000	97 365.50	0.08
Germany 0.1% 15.04.46 /Infl	0.100	15.04.46	EUR	1 000 000	2 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Germany 0.5% 14-15.04.30 /Infl	0.500	15.04.30	EUR	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Gn St Nord 0.875% 21-25.11.24	0.875	25.11.24	EUR	750 000	-	-	750 000	699 672.74	0.59
Groupama 6.375% (Frn) 14-Perp	6.375	31.12.99	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
H Lundbeck 0.875% 20-14.10.27	0.875	14.10.27	EUR	-	200 000	-	200 000	173 694.32	0.15
Heineken Nv 3.875% 23-23.09.30	3.875	23.09.30	EUR	-	100 000	-	100 000	101 379.09	0.09
Hellenic 4.25% 23-15.06.33	4.250	15.06.33	EUR	-	250 000	-250 000	-	-	0.00
Hera Spa 0.875% 19-05.07.27	0.875	05.07.27	EUR	-	200 000	-	200 000	177 952.00	0.15
Hessen 2.875% 23-04.07.33	2.875	04.07.33	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 485 222.00	1.26

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Hsbc Hldg 4.752% 10.03.28 Regs	4.752	10.03.28	EUR	-	400 000	-	400 000	400 176.80	0.34
Hsbc Hldg 4.787% 10.03.32 Regs	4.787	10.03.32	EUR	-	500 000	-	500 000	502 248.00	0.43
Ibb 2.75% 22-04.10.27	2.750	04.10.27	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	979 408.00	0.83
Iberdrola Int 1.45% 21-Perp	1.450	31.12.99	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Ibm Corp 0.30% 20-11.02.28	0.300	11.02.28	EUR	-	500 000	-	500 000	428 269.00	0.36
Icade Sa 1.5% 17-13.09.27 Regs	1.500	13.09.27	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Ico 1.30% 22-31.10.26	1.300	31.10.26	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 399 675.82	1.19
Ico 2.65% 22-31.01.28	2.650	31.01.28	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	965 992.00	0.82
In Justitia 9.25% 22-15.03.28	9.250	15.03.28	EUR	-	250 000	-250 000	-	-	0.00
Investec 0.50% 21-17.02.27	0.500	17.02.27	EUR	1 000 000	400 000	-800 000	600 000	509 893.80	0.43
Irland 1.35% 18-18.03.31	1.350	18.03.31	EUR	-	900 000	-900 000	-	-	0.00
Iren 0.25% 20-17.01.31	0.250	17.01.31	EUR	1 400 000	100 000	-1 400 000	100 000	74 272.50	0.06
Iren 1.95% 18-19.09.25	1.950	19.09.25	EUR	-	150 000	-	150 000	142 463.55	0.12
Isp 5.0% 23-08.03.28	5.000	08.03.28	EUR	-	150 000	-	150 000	149 867.70	0.13
Isp 5.625% 23-08.03.33	5.625	08.03.33	EUR	-	250 000	-	250 000	249 660.00	0.21
Italy 0.25% 21-15.03.28 /Btp	0.250	15.03.28	EUR	1 422 000	-	-	1 422 000	1 212 539.40	1.03
Italy 0.50% 20-01.02.26 /Btp	0.500	01.02.26	EUR	3 500 000	-	-2 000 000	1 500 000	1 380 903.17	1.17
Italy 0.95% 21-01.03.37 /Btp	0.950	01.03.37	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Italy 1.50% 20-30.04.45 /Btp	1.500	30.04.45	EUR	3 000 000	-	-2 000 000	1 000 000	618 870.00	0.52
Italy 4.0% 22-30.04.35 /Btp	4.000	30.04.35	EUR	-	3 300 000	-2 300 000	1 000 000	990 386.19	0.84
Italy 4.50% 01.10.53 /Btp 144A	4.500	01.10.53	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 022 500.00	0.87
Jnj 1.15% 16-20.11.28	1.150	20.11.28	EUR	-	100 000	-	100 000	89 276.20	0.08
John Deere 2.50% 22-14.09.26	2.500	14.09.26	EUR	-	100 000	-	100 000	96 208.40	0.08
Julius Baer 6.625% 23-Perp	6.625	31.12.99	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Jyske Bk 4.625% 22-11.04.26	4.625	11.04.26	EUR	-	500 000	-	500 000	496 242.00	0.42
Jyske Bk 5.50% 16.11.27 Regs	5.500	16.11.27	EUR	-	200 000	-	200 000	202 020.80	0.17
Kbc 1.50% (Frn) 22-29.03.26	1.500	29.03.26	EUR	500 000	-	-	500 000	474 369.50	0.40
Kbc 4.25% 18-Perp	4.250	31.12.99	EUR	-	600 000	-600 000	-	-	0.00
Kbc 4.375% 22-23.11.27 Regs	4.375	23.11.27	EUR	-	400 000	-	400 000	397 452.80	0.34
Kellogg Co 0.50% 21-20.05.29	0.500	20.05.29	EUR	-	400 000	-	400 000	328 890.00	0.28
Kfw 0.01% 19-05.05.27	0.010	05.05.27	EUR	-	500 000	-	500 000	443 019.00	0.38
Kfw 1.375% 22-07.06.32	1.375	07.06.32	EUR	7 000 000	-	-2 000 000	5 000 000	4 398 690.00	3.73
Kommkrdt 0.75% 18-05.07.28	0.750	05.07.28	EUR	-	200 000	-	200 000	177 492.20	0.15
Kommunalbk 2.75% 22-29.11.27	2.750	29.11.27	EUR	-	1 000 000	-200 000	800 000	778 180.00	0.66
Lbk Htg 4.0% 23-04.02.30	4.000	04.02.30	EUR	-	200 000	-	200 000	196 818.60	0.17
Ldkr B-W 0.375% 19-29.07.26	0.375	29.07.26	EUR	-	100 000	-	100 000	87 962.40	0.07
Ldkr B-W 4.0% 19-Perp	4.000	31.12.99	EUR	-	2 000 000	-1 600 000	400 000	286 159.20	0.24
Leaseplan 7.375% 19-Perp	7.375	31.12.99	EUR	1 250 000	200 000	-1 450 000	-	-	0.00
Liberty Mut 3.625% 19-23.05.59	3.625	23.05.59	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Liberty Mut 4.625% 22-02.12.30	4.625	02.12.30	EUR	-	500 000	-	500 000	485 669.50	0.41
Lietuvos En 2% 17-14.07.27 Regs	2.000	14.07.27	EUR	-	100 000	-	100 000	90 706.80	0.08
Luxemburg 0.0% 20-14.09.32	0.000	14.09.32	EUR	4 000 000	-	-2 000 000	2 000 000	1 528 218.00	1.29
Lvmh 0.125% 20-11.02.28 Regs	0.125	11.02.28	EUR	-	200 000	-	200 000	173 885.40	0.15
Madrid 0.42% 21-30.04.31	0.420	30.04.31	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	788 631.00	0.67
Madrid 1.723% 22-30.04.32	1.723	30.04.32	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 291 918.50	1.09
Madrid 3.362% 23-31.10.28	3.362	31.10.28	EUR	-	100 000	-	100 000	99 642.40	0.08
Madrid 3.596% 23-30.04.33	3.596	30.04.33	EUR	-	800 000	-	800 000	800 354.40	0.68
Medtrnc 1.375% 20-15.10.40	1.375	15.10.40	EUR	-	200 000	-	200 000	134 310.82	0.11
Morgan Stan 4.656% 23-02.03.29	4.656	02.03.29	EUR	-	400 000	-	400 000	402 416.80	0.34
Munhynp 0.01% 21-19.10.39	0.010	19.10.39	EUR	2 400 000	-	-	2 400 000	1 433 937.60	1.21
Munich Re 1.0% 21-26.05.42	1.000	26.05.42	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Munich Re 1.25% 20-26.05.41	1.250	26.05.41	EUR	-	300 000	-	300 000	229 395.00	0.19
Natwest 4.699% 23-14.03.28	4.699	14.03.28	EUR	-	200 000	-	200 000	199 005.20	0.17
Neste Oil 3.875% 23-16.03.29	3.875	16.03.29	EUR	-	100 000	-	100 000	99 942.20	0.08
Neste Oil 4.25% 23-16.03.33	4.250	16.03.33	EUR	-	100 000	-100 000	-	-	0.00
Nestle Fin 0.0% 20-03.03.33	0.000	03.03.33	EUR	-	50 000	-	50 000	36 742.65	0.03
Nestle Fin 0.875% 22-29.03.27	0.875	29.03.27	EUR	-	50 000	-	50 000	45 792.56	0.04
Nether Gove 0% 20-15.01.52	0.000	15.01.52	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Nether Gove 0.5% 19-15.01.40	0.500	15.01.40	EUR	8 250 000	2 100 000	-2 100 000	8 250 000	5 813 684.25	4.92

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Nether Gove 0.50% 22-15.07.32	0.500	15.07.32	EUR	6 000 000	-	-4 000 000	2 000 000	1 654 444.42	1.40
Nether Gove 2.50% 23-15.07.33	2.500	15.07.33	EUR	-	800 000	-500 000	300 000	295 166.70	0.25
Ngg Finance 1.625% 19-05.12.79	1.625	05.12.79	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Nibc Bk Nv 0.25% 21-09.09.26	0.250	09.09.26	EUR	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Nibc Bk Nv 0.875% 19-08.07.25	0.875	08.07.25	EUR	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Nn Group	4.500	31.12.99	EUR	-	900 000	-900 000	-	-	0.00
Nn Group 5.25% 22-01.03.43 Regs	5.250	01.03.43	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Nn Group 6.0% 23-03.11.43 Regs	6.000	03.11.43	EUR	-	100 000	-	100 000	100 171.29	0.09
Nrw Bk 0.0% 20-18.02.30	0.000	18.02.30	EUR	3 000 000	-	-	3 000 000	2 445 543.00	2.07
Nth Rhine 2.90% 15.01.53 Regs	2.900	15.01.53	EUR	-	3 000 000	-	3 000 000	2 878 231.35	2.44
Nth Rhine-W 0% 19-26.11.29	0.000	26.11.29	EUR	5 045 000	-	-	5 045 000	4 156 064.49	3.52
Nth Rhine-W 0.0% 20-12.10.35	0.000	12.10.35	EUR	3 000 000	-	-	3 000 000	2 055 978.00	1.74
Nth Rhine-W 0.95% 21-10.01.21	0.950	10.01.21	EUR	4 000 000	-	-4 000 000	-	-	0.00
Nth Rhine-W 1.45% 22-19.01.22	1.450	19.01.22	EUR	7 500 000	-	-6 500 000	1 000 000	507 250.61	0.43
Nwb 0.50% 21-26.04.51	0.500	26.04.51	EUR	1 600 000	-	-1 600 000	-	-	0.00
Orange 0.125% 20-16.09.29	0.125	16.09.29	EUR	-	100 000	-	100 000	81 794.00	0.07
Orange 0.50% 19-04.09.32	0.500	04.09.32	EUR	-	100 000	-	100 000	76 036.70	0.06
Orange 1.375% 18-20.03.28 Regs	1.375	20.03.28	EUR	-	100 000	-	100 000	90 856.30	0.08
Orange 5.375% 23-Perp Regs	5.375	31.12.99	EUR	-	200 000	-	200 000	198 480.40	0.17
Otp Bank 5.50% 22-13.07.25	5.500	13.07.25	EUR	-	100 000	-	100 000	99 504.50	0.08
Otp Bank 7.35% 22-04.03.26	7.350	04.03.26	EUR	-	100 000	-	100 000	101 273.00	0.09
Pandora 4.50% 23-10.04.28	4.500	10.04.28	EUR	-	100 000	-	100 000	99 795.22	0.08
Pepsico 0.875% 19-16.10.39	0.875	16.10.39	EUR	-	100 000	-	100 000	67 810.94	0.06
Pernod Ric 1.375% 07-04.29 Regs	1.375	07.04.29	EUR	-	300 000	-	300 000	267 107.70	0.23
Phoenix Gr 4.375% 18-24.01.29	4.375	24.01.29	EUR	1 000 000	500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Pko Bank 5.625% 23-01.02.26	5.625	01.02.26	EUR	-	200 000	-	200 000	200 569.88	0.17
Prcrho 6.0% 16-06.05.26	6.000	06.05.26	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	917 720.00	0.78
R Bosch Inv 2.625% 13-24.05.28	2.625	24.05.28	EUR	500 000	-	-	500 000	476 250.50	0.40
Raiffeisen 6.0% 20-Perp	6.000	31.12.99	EUR	-	2 600 000	-2 400 000	200 000	158 549.60	0.13
Raiffeisenb 7.125% 23-19.01.26	7.125	19.01.26	EUR	-	200 000	-	200 000	199 569.40	0.17
Red Ele Co 4.625% 23-Perp	4.625	31.12.99	EUR	-	200 000	-	200 000	197 138.00	0.17
Red Elec Fi 0.50% 21-24.05.33	0.500	24.05.33	EUR	-	200 000	-	200 000	155 196.80	0.13
Regiao Dos 1.095% 21-27.09.36	1.095	27.09.36	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	697 941.88	0.59
Rep Of Aus G B 1.85% 23.05.49	1.850	23.05.49	EUR	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Romania 5.0% 22-27.09.26	5.000	27.09.26	EUR	-	500 000	-	500 000	502 890.00	0.43
Romania 6.625% 22-27.09.29	6.625	27.09.29	EUR	-	500 000	-	500 000	519 840.00	0.44
Sage Grp 3.82% 23-15.02.28 Regs	3.820	15.02.28	EUR	-	200 000	-	200 000	197 593.50	0.17
Sampo Bk 2.50% 20-03.09.52	2.500	03.09.52	EUR	-	200 000	-100 000	100 000	77 504.70	0.07
Sanofi 1.125% 16-05.04.28	1.125	05.04.28	EUR	-	100 000	-	100 000	90 039.10	0.08
Saxony Anth 2.95% 23-20.06.33	2.950	20.06.33	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	996 779.00	0.84
Seb 3.25% 22-24.11.25	3.250	24.11.25	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Seb 4.125% 23-29.06.27	4.125	29.06.27	EUR	-	800 000	-	800 000	799 231.20	0.68
Shb 3.75% 22-01.11.27 Regs	3.750	01.11.27	EUR	-	200 000	-	200 000	198 523.82	0.17
Siemens Fin 2.75% 22-09.09.30	2.750	09.09.30	EUR	-	200 000	-	200 000	191 830.40	0.16
Smiths Grou 2% 17-23.02.27	2.000	23.02.27	EUR	-	250 000	-	250 000	231 841.50	0.20
Sncf Reseau 0.75% 19-25.05.36	0.750	25.05.36	EUR	-	200 000	-	200 000	144 403.20	0.12
Snr 2.375% 22-06.04.28	2.375	06.04.28	EUR	300 000	-	-	300 000	264 657.60	0.22
Socgen 7.875% 23-Perp	7.875	31.12.99	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Societe Par 1.125% 18-22.10.28	1.125	22.10.28	EUR	-	200 000	-	200 000	179 463.30	0.15
Sogecap Sa 4.125% /Frn 14-Perp	4.125	31.12.99	EUR	-	500 000	-400 000	100 000	95 350.17	0.08
Spanish Gov 0.0% 21-31.01.28	0.000	31.01.28	EUR	-	750 000	-	750 000	647 785.50	0.55
Spanish Gov 1.0% 21-30.07.42	1.000	30.07.42	EUR	-	500 000	-	500 000	314 947.00	0.27
Spbk Bolikr 0.5% 18-30.01.25	0.500	30.01.25	EUR	-	200 000	-	200 000	189 692.92	0.16
Sse 0.875% 17-06.09.25 Regs	0.875	06.09.25	EUR	-	200 000	-	200 000	187 475.40	0.16
Sse 2.875% 22-01.08.29 Regs	2.875	01.08.29	EUR	-	150 000	-	150 000	142 450.80	0.12
Sse 4.0% 22-Perp	4.000	31.12.99	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Svensk Expo 2.0% 22-30.06.27	2.000	30.06.27	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 418 193.00	1.20
Swiss Life 4.375% 15-Perp	4.375	31.12.99	EUR	-	500 000	-	500 000	489 509.11	0.41
Sydbank 4.75% 22-30.09.25	4.750	30.09.25	EUR	-	500 000	-	500 000	496 406.00	0.42

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Technipfmc 3.75% 13-07.10.33	3.750	07.10.33	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Telefonica	5.875	31.12.99	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Telefonica 1.201% 20-21.08.27	1.201	21.08.27	EUR	-	100 000	-	100 000	91 007.90	0.08
Telefonica 1.807% 20-21.05.32	1.807	21.05.32	EUR	-	100 000	-	100 000	85 391.40	0.07
Telefonica 6.135% 23-Perp	6.135	31.12.99	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Telefonica 7.125% 22-Perp	7.125	31.12.99	EUR	-	100 000	-100 000	-	-	0.00
Terna 2.375% 22-Perp	2.375	31.12.99	EUR	950 000	-	-950 000	-	-	0.00
Tor Dom 1.952% 22-08.04.30 B Regs	1.952	08.04.30	EUR	-	550 000	-	550 000	478 651.80	0.41
Totalenergies 2.0% 20-Perp	2.000	31.12.99	EUR	-	681 000	-681 000	-	-	0.00
Triodos Bk 2.25% 21-05.02.32	2.250	05.02.32	EUR	500 000	300 000	-800 000	-	-	0.00
Ubi 5.875% 20-Perp	5.875	31.12.99	EUR	-	1 200 000	-1 200 000	-	-	0.00
Ubs Group F 0.25% 21-03.11.26	0.250	03.11.26	EUR	-	250 000	-	250 000	222 920.25	0.19
Ubs Group F 4.625% 23-17.03.28	4.625	17.03.28	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Ubs Group F 4.75% 23-17.03.32	4.750	17.03.32	EUR	-	100 000	-	100 000	99 718.70	0.08
Unibail Rod	1.000	14.03.25	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Unibail Rod 2.125% 18-Perp	2.125	31.12.99	EUR	1 100 000	700 000	-1 800 000	-	-	0.00
Unilev Cap 3.40% 23-06.06.33	3.400	06.06.33	EUR	-	100 000	-	100 000	98 466.70	0.08
Unilever 1.375% 18-04.09.30	1.375	04.09.30	EUR	-	200 000	-	200 000	173 756.01	0.15
Verizon Com 0.375% 21-22.03.29	0.375	22.03.29	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Verizon Com 0.75% 21-22.03.32	0.750	22.03.32	EUR	-	100 000	-	100 000	76 576.50	0.07
Verizon Com 1.375% 16-02.11.28	1.375	02.11.28	EUR	-	100 000	-	100 000	87 823.50	0.07
Vestas Wind 2.0% 22-15.06.34	2.000	15.06.34	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Vivat Nv 7% 18-Perp Regs	7.000	31.12.99	EUR	-	500 000	-	500 000	473 168.00	0.40
Vodafone 2.625% 20-27.08.80	2.625	27.08.80	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Vodafone In 3.25% 22-02.03.29	3.250	02.03.29	EUR	-	300 000	-150 000	150 000	145 701.00	0.12
Vodafone In 3.75% 22-02.12.34	3.750	02.12.34	EUR	-	300 000	-100 000	200 000	194 012.80	0.16
Volksbank 4.75% 23-15.03.27	4.750	15.03.27	EUR	-	400 000	-	400 000	394 011.42	0.33
Volksbank 7.75% 19-Perp	7.750	31.12.99	EUR	2 000 000	600 000	-2 600 000	-	-	0.00
Zuercher Kb 0.0% 21-15.05.26	0.000	15.05.26	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 344 856.50	1.14
							112 170 951.65	94.99	

Indexoptionen

Euro Bobl	23.09.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bobl	23.09.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bobl	23.09.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	24.02.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	26.08.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	26.08.22	EUR	-	50	-50	-	-	0.00
Euro Bund	26.08.22	EUR	-	75	-75	-	-	0.00
Euro Bund	26.08.22	EUR	-	25	-25	-	-	0.00
Euro Bund	26.08.22	EUR	-	25	-25	-	-	0.00
Euro Bund	26.08.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	26.08.22	EUR	-	60	-60	-	-	0.00
Euro Bund	23.09.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	23.09.22	EUR	-	250	-250	-	-	0.00
Euro Bund	23.09.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	24.02.23	EUR	-	130	-130	-	-	0.00
Euro Bund	23.09.22	EUR	-	200	-200	-	-	0.00
Euro Bund	23.09.22	EUR	-	250	-250	-	-	0.00
Euro Bund	23.09.22	EUR	-	200	-200	-	-	0.00
Euro Bund	23.09.22	EUR	-	200	-200	-	-	0.00
Euro Bund	25.11.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	25.11.22	EUR	-	50	-50	-	-	0.00
Euro Bund	21.10.22	EUR	-	350	-350	-	-	0.00
Euro Bund	21.10.22	EUR	-	200	-200	-	-	0.00
Euro Bund	21.10.22	EUR	-	350	-350	-	-	0.00
Euro Bund	21.10.22	EUR	-	250	-250	-	-	0.00
Euro Bund	24.02.23	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
Euro Bund	21.10.22	EUR	-	175	-175	-	-	0.00

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Euro Bund		21.10.22	EUR	-	200	-200	-	-	0.00
Euro Bund		25.11.22	EUR	-	125	-125	-	-	0.00
Euro Bund		21.10.22	EUR	-	50	-50	-	-	0.00
Euro Bund		21.10.22	EUR	-	250	-250	-	-	0.00
Euro Bund		21.10.22	EUR	-	200	-200	-	-	0.00
Euro Bund		25.11.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund		26.08.22	EUR	-	75	-75	-	-	0.00
Euro Bund		26.08.22	EUR	-	520	-520	-	-	0.00
Euro Bund		26.08.22	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
Euro Bund		26.08.22	EUR	-	250	-250	-	-	0.00
Euro Bund		26.08.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund		26.08.22	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
								-	0.00

Schatzwechsel

Deutschland 0% 13.04.23 Tb		13.04.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Deutschland 0% 21.06.23 Tb Regs		21.06.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Deutschland 0% 21-14.12.22 Tb		14.12.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Deutschland 0% 22-18.01.23 Tb		18.01.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Deutschland 0% 22-19.07.23 Tb		19.07.23	EUR	-	100	-	100	99.86	0.00
Deutschland 0% 23-13.12.23 Tb		13.12.23	EUR	-	100	-	100	98.44	0.00
Deutschland 0% 23-15.05.24 Tb		15.05.24	EUR	-	100	-	100	96.91	0.00
Deutschland 0% 23-17.01.24 Tb		17.01.24	EUR	-	100	-	100	98.13	0.00
Deutschland 0% 23-19.06.24 Tb		19.06.24	EUR	-	100	-	100	96.60	0.00
Deutschland 0% 23-20.03.24 Tb		20.03.24	EUR	-	100	-	100	97.51	0.00
Deutschland 0% 23-21.02.24 Tb		21.02.24	EUR	-	100	-	100	97.77	0.00
Germany 0% 22-22.03.23 Tb		22.03.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
								685.22	0.00

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								112 171 636.87	94.99
---	--	--	--	--	--	--	--	-----------------------	--------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Autostrade 5.125% 14.06.33 Regs	5.125	14.06.33	EUR	-	200 000	-	200 000	200 556.80	0.17
Banca Ifis 6.125% 23-19.01.27	6.125	19.01.27	EUR	-	150 000	-	150 000	150 228.90	0.13
Bpce 4.125% 23-10.07.28	4.125	10.07.28	EUR	-	200 000	-	200 000	200 027.00	0.17
France O.A. 0% 16-25.05.52	0.000	25.05.52	EUR	6 500 000	2 500 000	-9 000 000	-	-	0.00
Jfm 0.05% 20-12.02.27	0.050	12.02.27	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	878 115.00	0.74
Ldkr B-W 0.25% 21-21.07.28	0.250	21.07.28	EUR	-	300 000	-	300 000	246 817.00	0.21
Met Tenerif 1.229% 21-30.07.36	1.229	30.07.36	EUR	1 000 000	400 000	-1 400 000	-	-	0.00
Orsted 5.25% 22-08.12.22	5.250	08.12.22	EUR	-	200 000	-	200 000	199 241.60	0.17
Socgen 4.25% 22-06.12.30	4.250	06.12.30	EUR	-	500 000	-	500 000	483 937.50	0.41
Spain 0% 17-30.07.48 /Stp Io	0.000	30.07.48	EUR	1 500 000	-	-500 000	1 000 000	379 668.50	0.32
Spbk Bolikr 0.05% 21-03.11.28	0.050	03.11.28	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Vr-Group PI 2.375% 22-30.05.29	2.375	30.05.29	EUR	800 000	-	-	800 000	730 927.52	0.62
								3 469 519.82	2.94

Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								3 469 519.82	2.94
--	--	--	--	--	--	--	--	---------------------	-------------

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Sonstige übertragbare Wertpapiere									
Anleihen									
Lbk Berlin 1.75% 19-01.10.29	1.750	01.10.29	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
								-	0.00
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere								-	0.00
SUMME WERTPAPIERBESTAND								115 641 156.69	97.93
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								3 279 672.33	2.78
Sonstige Passiven								-837 598.99	-0.71
GESAMTNETTOVERMÖGEN								118 083 230.03	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Anleihen

A2A 0.625% 21-15.07.31	0.625	15.07.31	EUR	-	800 000	-	800 000	599 747.20	0.69
Aareal Bk 4.50% 22-25.07.25	4.500	25.07.25	EUR	-	300 000	-	300 000	291 255.00	0.34
Ab Inbev 2% 18-23.01.35	2.000	23.01.35	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	847 575.00	0.97
Abb Fin Bv 3.375% 23-16.01.31	3.375	16.01.31	EUR	-	400 000	-	400 000	392 641.60	0.45
Abbott II F O 0.375% 19-19.11.27	0.375	19.11.27	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	876 587.98	1.01
Abertis	1.375	20.05.26	EUR	700 000	-	-400 000	300 000	279 398.44	0.32
Abertis 1.25% 20-07.02.28	1.250	07.02.28	EUR	-	100 000	-	100 000	88 332.70	0.10
Accor 1.75% 19-04.02.26	1.750	04.02.26	EUR	500 000	-	-	500 000	483 342.00	0.56
Achmea Bv 4.25% 15-Perp	4.250	31.12.99	EUR	-	500 000	-	500 000	486 610.00	0.56
Achmea Bv 6% 13-04.04.43	6.000	04.04.43	EUR	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Adidas 3.125% 22-21.11.29 Regs	3.125	21.11.29	EUR	-	200 000	-	200 000	196 166.80	0.23
Aegon 4% 14-25.04.44	4.000	25.04.44	EUR	-	1 000 000	-500 000	500 000	491 700.50	0.57
Aegon Nv Frn	0.000	31.12.99	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Air Liquide 0.375% 21-27.05.31	0.375	27.05.31	EUR	-	200 000	-	200 000	161 700.80	0.19
Akzo Nobel 1.625% 20-14.04.30	1.625	14.04.30	EUR	-	200 000	-	200 000	171 999.00	0.20
Allianz 4.252% 22-05.07.52	4.252	05.07.52	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Alpha Bank 6.875% 23-27.06.29	6.875	27.06.29	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	995 655.00	1.15
Amadeus It 2.50% 20-20.05.24	2.500	20.05.24	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Amp Tech Hd 0.75% 20-04.05.26	0.750	04.05.26	EUR	500 000	-	-	500 000	457 392.50	0.53
Amp Tech Hd 2% 18-08.10.28	2.000	08.10.28	EUR	500 000	-	-	500 000	460 759.15	0.53
Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	0.500	15.11.31	EUR	1 500 000	-	-1 000 000	500 000	403 719.00	0.46
Apple Inc 1.375% 17-24.05.29	1.375	24.05.29	EUR	-	700 000	-	700 000	629 440.70	0.72
Apt Pipelin 2.0% 20-15.07.30	2.000	15.07.30	EUR	800 000	-	-	800 000	682 098.40	0.78
Aroundtown 1.625% 21-Perp	1.625	31.12.99	EUR	-	1 300 000	-	1 300 000	398 122.40	0.46
Assgen 2.124% 19-01.10.30	2.124	01.10.30	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Athora Hold 6.625% 23-16.06.28	6.625	16.06.28	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	991 596.00	1.14
Atradius Fi 5.25% 14-23.09.44	5.250	23.09.44	EUR	-	700 000	-600 000	100 000	98 217.30	0.11
Auchan 3.25% 20-23.07.27	3.250	23.07.27	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Axa Frn 04-Perp	0.000	31.12.99	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Axa-Uap Frn 04	0.000	31.12.99	EUR	1 250 000	-	-1 250 000	-	-	0.00
Banc Ifis 4.5% 17-17.10.27 Regs	4.500	17.10.27	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Banco Cred 1.75% 21-09.03.28	1.750	09.03.28	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Banco Cred 8.0% 22-22.09.26	8.000	22.09.26	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Bauspark Wu 4.125% 17-27.10.27	4.125	27.10.27	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Bbva 0.50% 20-14.01.27	0.500	14.01.27	EUR	700 000	-	-	700 000	615 519.80	0.71
Bbva 6.0% 20-Perp	6.000	31.12.99	EUR	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Bco Sab 1.125% 20-11.03.27	1.125	11.03.27	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Bco Sab 2.625% 22-24.03.26	2.625	24.03.26	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Bco Sab 5.125% 22-10.11.28	5.125	10.11.28	EUR	-	200 000	-	200 000	201 786.10	0.23
Bco Sab 6.00% 23-16.08.33 Regs	6.000	16.08.33	EUR	-	400 000	-	400 000	369 829.60	0.43
Belfius Bk 3.625% 18-Perp	3.625	31.12.99	EUR	400 000	1 400 000	-1 800 000	-	-	0.00
Belfius Bk 3.875% 23-12.06.28	3.875	12.06.28	EUR	-	400 000	-	400 000	396 676.33	0.46
Belfius Bk 5.25% 23-19.04.33	5.250	19.04.33	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Bfcm 0.01% 21-07.03.25	0.010	07.03.25	EUR	100 000	-	-	100 000	93 120.30	0.11
Bfcm 2.625% 22-06.11.29	2.625	06.11.29	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	900 754.00	1.04
Bfcm 3.75% 22-01.02.33	3.750	01.02.33	EUR	-	300 000	-	300 000	291 662.10	0.34
Bfcm 3.875% 22-16.06.32	3.875	16.06.32	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Bmw Fin 3.25% 23-22.07.30	3.250	22.07.30	EUR	-	800 000	-	800 000	786 068.00	0.90
Bpce 1% 19-01.04.25	1.000	01.04.25	EUR	600 000	-	-	600 000	566 274.05	0.65
Bpce Sfh 1.75% 22-27.05.32	1.750	27.05.32	EUR	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Bqe Postale 0.75% 21-02.08.32	0.750	02.08.32	EUR	-	400 000	-	400 000	323 279.20	0.37
Bqe Postale 3.0% 21-Perp	3.000	31.12.99	EUR	-	1 400 000	-1 400 000	-	-	0.00
Bqe Postale 4.375% 23-17.01.30	4.375	17.01.30	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Brenntag 0.50% 21-06.10.29	0.500	06.10.29	EUR	-	100 000	-	100 000	80 204.10	0.09

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Brisa C Rod 2.375% 17-10.05.27	2.375	10.05.27	EUR	500 000	-	-	500 000	477 030.00	0.55
Britel 1.5% 17-23.06.27	1.500	23.06.27	EUR	500 000	-	-	500 000	455 580.00	0.52
By Lbk 1.0% 21-23.09.31	1.000	23.09.31	EUR	-	600 000	-	600 000	491 992.52	0.57
By Lbk 3.75% 23-07.02.29	3.750	07.02.29	EUR	-	500 000	-	500 000	483 232.84	0.56
By Lbk 4.25% 23-21.06.27	4.250	21.06.27	EUR	-	500 000	-	500 000	497 620.50	0.57
Caixabank 0.625% 19-01.10.24	0.625	01.10.24	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Caixabank 3.625% 21-Perp	3.625	31.12.99	EUR	-	2 200 000	-2 200 000	-	-	0.00
Castellum 0.75% 19-04.09.26	0.750	04.09.26	EUR	400 000	-	-	400 000	329 513.20	0.38
Castellum 2.125% 18-20.11.23 Regs	2.125	20.11.23	EUR	400 000	-	-	400 000	394 020.40	0.45
Cattol Ass 4.25% 17-14.12.47	4.250	14.12.47	EUR	600 000	-	-300 000	300 000	288 769.05	0.33
Cnp Assuran 1.25% 27.01.29 Regs	1.250	27.01.29	EUR	-	700 000	-600 000	100 000	82 813.02	0.10
Co Fin 0.50% 22-16.03.28	0.500	16.03.28	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Coca Cola 0.375% 20-15.03.33	0.375	15.03.33	EUR	-	100 000	-	100 000	74 577.19	0.09
Comcast 0.0% 21-14.09.26	0.000	14.09.26	EUR	-	200 000	-	200 000	176 887.60	0.20
Comcast 0.25% 20-20.05.27	0.250	20.05.27	EUR	-	500 000	-	500 000	436 433.73	0.50
Comcast 0.75% 20-20.02.32	0.750	20.02.32	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	786 977.00	0.91
Comzkb 6.125% 20-Perp	6.125	31.12.99	EUR	-	4 400 000	-4 400 000	-	-	0.00
Continental 3.625% 22-30.11.27	3.625	30.11.27	EUR	-	200 000	-	200 000	197 716.40	0.23
Cred Agric 4.125% 07.03.30 Regs	4.125	07.03.30	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 012 045.00	1.16
Dbs Group 1.5% 18-11.04.28	1.500	11.04.28	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
De Volksban 7.0% 22-Perp	7.000	31.12.99	EUR	700 000	700 000	-1 400 000	-	-	0.00
Dell Bank 0.50% 27.10.26 Regs	0.500	27.10.26	EUR	500 000	-	-	500 000	442 732.50	0.51
Delta Lloyd	4.375	31.12.99	EUR	600 000	1 200 000	-1 649 000	151 000	149 007.25	0.17
Deut Kredbk 0.75% 17-26.09.24	0.750	26.09.24	EUR	200 000	-	-	200 000	191 722.40	0.22
Deut Tel 1.375% 19-05.07.34 Regs	1.375	05.07.34	EUR	-	200 000	-	200 000	161 507.98	0.19
Deut Tel If 1.125% 17-22.05.26	1.125	22.05.26	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Deutsch 1.375% 18-28.03.31 Regs	1.375	28.03.31	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	1 728 504.00	1.99
Diageo Cap 0.125% 20-28.09.28	0.125	28.09.28	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	844 795.01	0.97
Ds Smith 0.875% 12.09.26 Regs	0.875	12.09.26	EUR	400 000	-	-	400 000	357 787.40	0.41
Dt Bahn Fin 0.625% 20-08.12.50	0.625	08.12.50	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	506 107.00	0.58
Dtch Wohnen 1.0% 20-30.04.25	1.000	30.04.25	EUR	1 000 000	-	-400 000	600 000	559 981.41	0.64
E.On 0.375% 20-29.09.27	0.375	29.09.27	EUR	-	100 000	-	100 000	87 813.20	0.10
E.On 1.625% 22-29.03.31	1.625	29.03.31	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 302 610.50	1.50
East Japan 0.773% 15.09.34 Regs	0.773	15.09.34	EUR	900 000	-	-300 000	600 000	441 684.41	0.51
Edenred 1.375% 20-18.06.29	1.375	18.06.29	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Edp 3.875% 23-26.06.28	3.875	26.06.28	EUR	-	100 000	-	100 000	99 867.90	0.11
Eli Lilly 0.625% 19-01.11.31	0.625	01.11.31	EUR	300 000	-	-	300 000	239 967.30	0.28
Elia Group 5.85% 23-Perp	5.850	31.12.99	EUR	-	100 000	-	100 000	100 559.90	0.12
Elm Bv 3.375% 17-29.09.47 Regs	3.375	29.09.47	EUR	-	500 000	-	500 000	451 607.50	0.52
Emerson El 1.25% 19-15.10.25	1.250	15.10.25	EUR	700 000	-	-	700 000	657 675.20	0.76
Enel 6.375% 23-Perp Regs	6.375	31.12.99	EUR	-	100 000	-100 000	-	-	0.00
Enxsis 3.625% 23-12.06.34	3.625	12.06.34	EUR	-	200 000	-	200 000	200 734.20	0.23
Eqf 2.875% 22-06.04.32	2.875	06.04.32	EUR	750 000	-	-	750 000	598 756.05	0.69
Ericsson 1.125% 22-08.02.27	1.125	08.02.27	EUR	2 500 000	-	-2 400 000	100 000	88 293.40	0.10
Erste Bk 0.10% 20-16.11.28	0.100	16.11.28	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	836 315.22	0.96
Erste Bk 4.0% 23-16.01.31	4.000	16.01.31	EUR	-	600 000	-	600 000	589 954.80	0.68
Eurofins 3.75% 20-17.07.26	3.750	17.07.26	EUR	500 000	-	-	500 000	491 462.50	0.57
Eurogrid 3.279% 22-05.09.31	3.279	05.09.31	EUR	-	200 000	-	200 000	194 175.24	0.22
Fastighets 1.25% 20-28.01.28	1.250	28.01.28	EUR	600 000	-	-	600 000	419 753.40	0.48
Fondiaría	5.750	31.12.99	EUR	750 000	1 050 000	-200 000	1 600 000	1 584 400.00	1.82
Fresenius M 1.50% 20-29.05.30	1.500	29.05.30	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Gas Nat 0.875% 17-15.05.25 Regs	0.875	15.05.25	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Generali Fi 4.596% 14-Perp Regs	4.596	31.12.99	EUR	1 150 000	550 000	-1 300 000	400 000	389 462.00	0.45
Glbwr Re Es 3% 18-29.03.25 Regs	3.000	29.03.25	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	827 514.00	0.95
Gn St Nord 0.875% 21-25.11.24	0.875	25.11.24	EUR	1 000 000	500 000	-	1 500 000	1 399 345.47	1.61
Gr City Pr 1.50% 20-Perp	1.500	31.12.99	EUR	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Groupama 6.375% (Frn) 14-Perp	6.375	31.12.99	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
H Lundbeck 0.875% 20-14.10.27	0.875	14.10.27	EUR	-	200 000	-	200 000	173 694.32	0.20
Heineken Nv 3.875% 23-23.09.30	3.875	23.09.30	EUR	-	100 000	-	100 000	101 379.09	0.12

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Hld Inf Tr 2.5% 20-04.05.27	2.500	04.05.27	EUR	300 000	-	-	300 000	280 502.10	0.32
Hld Inf Tra 1.625% 20-18.09.29	1.625	18.09.29	EUR	800 000	-	-300 000	500 000	427 412.00	0.49
Hsbc Hldg 4.752% 10.03.28 Regs	4.752	10.03.28	EUR	-	800 000	-	800 000	800 353.60	0.92
Hsbc Hldg 4.787% 10.03.32 Regs	4.787	10.03.32	EUR	-	800 000	-	800 000	803 596.80	0.92
Iberdrola I 2.625% 18-Perp	2.625	31.12.99	EUR	500 000	-	-400 000	100 000	98 617.80	0.11
Iberdrola Int 1.45% 21-Perp	1.450	31.12.99	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Ibm Corp 0.30% 20-11.02.28	0.300	11.02.28	EUR	-	500 000	-	500 000	428 269.00	0.49
Icade Sa 1.5% 17-13.09.27 Regs	1.500	13.09.27	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Ico 2.65% 22-31.01.28	2.650	31.01.28	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Imerys 1.0% 21-15.07.31	1.000	15.07.31	EUR	500 000	-	-	500 000	379 530.00	0.44
In Justitia 9.25% 22-15.03.28	9.250	15.03.28	EUR	-	500 000	-	500 000	424 237.50	0.49
Investec 0.50% 21-17.02.27	0.500	17.02.27	EUR	-	1 200 000	-	1 200 000	1 019 787.60	1.17
Iren 0.25% 20-17.01.31	0.250	17.01.31	EUR	1 400 000	-	-1 400 000	-	-	0.00
Iren 0.875% 19-14.10.29 Regs	0.875	14.10.29	EUR	300 000	-	-	300 000	247 541.40	0.28
Isp 1% 19-19.11.26 Regs	1.000	19.11.26	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Isp 5.0% 23-08.03.28	5.000	08.03.28	EUR	-	300 000	-	300 000	299 735.40	0.34
Isp 5.625% 23-08.03.33	5.625	08.03.33	EUR	-	500 000	-	500 000	499 320.00	0.57
Itv 1.375% 19-26.09.26	1.375	26.09.26	EUR	400 000	-	-	400 000	364 802.00	0.42
Itv 2% 16-01.12.23	2.000	01.12.23	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Jnj 1.15% 16-20.11.28	1.150	20.11.28	EUR	2 000 000	-	-1 000 000	1 000 000	892 762.00	1.03
John Deere 1.375% 20-02.04.24	1.375	02.04.24	EUR	1 000 000	-	-700 000	300 000	294 389.10	0.34
John Deere 2.50% 22-14.09.26	2.500	14.09.26	EUR	-	200 000	-	200 000	192 416.80	0.22
Julius Baer 6.625% 23-Perp	6.625	31.12.99	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Jyske Bk 4.625% 22-11.04.26	4.625	11.04.26	EUR	-	500 000	-	500 000	496 242.00	0.57
Jyske Bk 5.50% 16.11.27 Regs	5.500	16.11.27	EUR	-	500 000	-	500 000	505 052.00	0.58
Kbc 1.50% (Frn) 22-29.03.26	1.500	29.03.26	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	948 739.00	1.09
Kbc 4.25% 18-Perp	4.250	31.12.99	EUR	-	600 000	-600 000	-	-	0.00
Kbc 4.375% 22-23.11.27 Regs	4.375	23.11.27	EUR	-	500 000	-	500 000	496 816.00	0.57
Kellogg Co 0.50% 21-20.05.29	0.500	20.05.29	EUR	-	400 000	-	400 000	328 890.00	0.38
Klepierre 1.375% 17-16.02.27	1.375	16.02.27	EUR	1 000 000	-	-900 000	100 000	91 556.50	0.11
Kpn 0.875% 20-14.12.32 Regs	0.875	14.12.32	EUR	-	200 000	-	200 000	152 462.07	0.18
Kpn 6.0% 22-Perp	6.000	31.12.99	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Lbk Bw 3.625% 15-16.06.25	3.625	16.06.25	EUR	1 000 000	-	-500 000	500 000	482 410.50	0.55
Lbk Htg 4.0% 23-04.02.30	4.000	04.02.30	EUR	-	200 000	-	200 000	196 818.60	0.23
Ldkr B-W 0.375% 29.07.26 Regs	0.375	29.07.26	EUR	-	200 000	-	200 000	175 924.80	0.20
Ldkr B-W 2.20% 19-09.05.29 Regs	2.200	09.05.29	EUR	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Ldkr B-W 4.0% 19-Perp	4.000	31.12.99	EUR	-	1 200 000	-600 000	600 000	429 238.80	0.49
Leaseplan 7.375% 19-Perp	7.375	31.12.99	EUR	1 700 000	300 000	-2 000 000	-	-	0.00
Leg Immobi 0.75% 21-30.06.31	0.750	30.06.31	EUR	100 000	-	-	100 000	72 519.50	0.08
Liberty Mut 3.625% 19-23.05.59	3.625	23.05.59	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Liberty Mut 4.625% 22-02.12.30	4.625	02.12.30	EUR	-	500 000	-	500 000	485 669.50	0.56
Linde Fin 0.55% 20-19.05.32	0.550	19.05.32	EUR	-	200 000	-	200 000	154 392.60	0.18
Lvmh 0.125% 20-11.02.28 Regs	0.125	11.02.28	EUR	-	400 000	-	400 000	347 770.80	0.40
Macquarie G 0.95% 21-21.05.31	0.950	21.05.31	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 166 386.50	1.34
Madrilena R 1.375% 17-11.04.25	1.375	11.04.25	EUR	600 000	-	-	600 000	564 030.00	0.65
Madrilena R 2.25% 17-11.04.29	2.250	11.04.29	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	853 708.00	0.98
Manpower 1.75% 18-22.06.26	1.750	22.06.26	EUR	500 000	-	-	500 000	468 432.63	0.54
Medtrnc 1.125% 19-07.03.27	1.125	07.03.27	EUR	900 000	-	-	900 000	820 137.60	0.94
Medtrnc 1.375% 20-15.10.40	1.375	15.10.40	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 007 331.15	1.16
Merck Kgaa 1.625% 20-09.09.80	1.625	09.09.80	EUR	1 400 000	-	-1 400 000	-	-	0.00
Metsa Board 2.75% 17-29.09.27	2.750	29.09.27	EUR	700 000	-	-	700 000	665 107.10	0.76
Morgan Stan 4.656% 23-02.03.29	4.656	02.03.29	EUR	-	600 000	-	600 000	603 625.20	0.69
Munhvp 0.01% 21-19.10.39	0.010	19.10.39	EUR	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Munich Re 1.0% 21-26.05.42	1.000	26.05.42	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Munich Re 1.25% 20-26.05.41	1.250	26.05.41	EUR	-	500 000	-	500 000	382 325.00	0.44
Nat Bui Soc 1.5% 18-08.03.26	1.500	08.03.26	EUR	700 000	-	-	700 000	661 866.38	0.76
Natwest 4.699% 23-14.03.28	4.699	14.03.28	EUR	-	400 000	-	400 000	398 010.40	0.46
Neste Oil 3.875% 23-16.03.29	3.875	16.03.29	EUR	-	200 000	-	200 000	199 884.40	0.23
Neste Oil 4.25% 23-16.03.33	4.250	16.03.33	EUR	-	100 000	-	100 000	101 207.10	0.12

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Nestle Fin 0.0% 20-03.03.33	0.000	03.03.33	EUR	-	200 000	-	200 000	146 970.60	0.17
Nestle Fin 0.875% 22-29.03.27	0.875	29.03.27	EUR	-	200 000	-	200 000	183 170.25	0.21
Nestle Fin 3.75% 23-13.03.33	3.750	13.03.33	EUR	-	100 000	-	100 000	103 599.20	0.12
Ngg Finance 1.625% 19-05.12.79	1.625	05.12.79	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Nibc Bk Nv 0.25% 21-09.09.26	0.250	09.09.26	EUR	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Nn Group	4.500	31.12.99	EUR	-	1 150 000	-1 150 000	-	-	0.00
Nn Group 5.25% 22-01.03.43 Regs	5.250	01.03.43	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Nn Group 6.0% 23-03.11.43 Regs	6.000	03.11.43	EUR	-	200 000	-	200 000	200 342.58	0.23
Ntt Leasing 0.082% 21-13.12.25	0.082	13.12.25	EUR	-	500 000	-	500 000	455 898.00	0.52
Omv 0.75% 20-16.06.30	0.750	16.06.30	EUR	-	400 000	-	400 000	330 923.60	0.38
Omv Ag 1% 19-03.07.34 Regs	1.000	03.07.34	EUR	-	400 000	-	400 000	296 579.20	0.34
Orange 0.0% 21-29.06.26	0.000	29.06.26	EUR	-	100 000	-	100 000	89 679.80	0.10
Orange 0.125% 20-16.09.29	0.125	16.09.29	EUR	-	200 000	-	200 000	163 588.00	0.19
Orange 0.50% 19-04.09.32	0.500	04.09.32	EUR	-	100 000	-	100 000	76 036.70	0.09
Orange 1.375% 18-20.03.28 Regs	1.375	20.03.28	EUR	-	100 000	-	100 000	90 856.30	0.10
Orange 5.375% 23-Perp Regs	5.375	31.12.99	EUR	-	500 000	-	500 000	496 201.00	0.57
Otp Bank 5.50% 22-13.07.25	5.500	13.07.25	EUR	-	700 000	-	700 000	696 531.50	0.80
Otp Bank 7.35% 22-04.03.26	7.350	04.03.26	EUR	-	400 000	-	400 000	405 092.00	0.47
Pandora 4.50% 23-10.04.28	4.500	10.04.28	EUR	-	200 000	-	200 000	199 590.45	0.23
Pepsico 0.875% 19-16.10.39	0.875	16.10.39	EUR	500 000	-	-	500 000	339 054.68	0.39
Pernod Ric 1.375% 07.04.29 Regs	1.375	07.04.29	EUR	-	500 000	-	500 000	445 179.50	0.51
Phoenix Gr 4.375% 18-24.01.29	4.375	24.01.29	EUR	1 000 000	500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Pko Bank 5.625% 23-01.02.26	5.625	01.02.26	EUR	-	400 000	-	400 000	401 139.76	0.46
Prologis In 2.375% 18-14.11.30	2.375	14.11.30	EUR	600 000	-	-500 000	100 000	83 744.10	0.10
Prolos Eu 0.625% 19-10.09.31	0.625	10.09.31	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
R Bosch 4.0% 23-02.06.35	4.000	02.06.35	EUR	-	200 000	-	200 000	203 147.60	0.23
R Bosch Inv 2.625% 13-24.05.28	2.625	24.05.28	EUR	800 000	-	-	800 000	762 000.80	0.88
Raiffeisen 6.125% 17-Perp	6.125	31.12.99	EUR	-	600 000	-	600 000	535 415.40	0.62
Raiffeisen 6.0% 20-Perp	6.000	31.12.99	EUR	-	3 400 000	-3 000 000	400 000	317 099.20	0.36
Raiffeisenb 7.125% 23-19.01.26	7.125	19.01.26	EUR	-	300 000	-	300 000	299 354.10	0.34
Red Ele Co 4.625% 23-Perp	4.625	31.12.99	EUR	-	200 000	-	200 000	197 138.00	0.23
Rentokil In 0.50% 20-14.10.28	0.500	14.10.28	EUR	500 000	-	-	500 000	419 073.38	0.48
Sagax 2.25% 19-13.03.25	2.250	13.03.25	EUR	400 000	-	-	400 000	377 942.80	0.43
Sage Grp 3.82% 23-15.02.28 Regs	3.820	15.02.28	EUR	-	400 000	-	400 000	395 187.00	0.45
Sampo Bk 2.50% 20-03.09.52	2.500	03.09.52	EUR	-	400 000	-	400 000	310 018.80	0.36
Sanofi 1.125% 16-05.04.28	1.125	05.04.28	EUR	-	200 000	-	200 000	180 078.20	0.21
Schneid El 1.5% 19-15.01.28	1.500	15.01.28	EUR	500 000	-	-	500 000	459 467.50	0.53
Scor Se	3.000	08.06.46	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Seb 3.25% 22-24.11.25	3.250	24.11.25	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Seb 4.125% 23-29.06.27	4.125	29.06.27	EUR	-	800 000	-	800 000	799 231.20	0.92
Shb 3.75% 22-01.11.27 Regs	3.750	01.11.27	EUR	-	400 000	-	400 000	397 047.64	0.46
Siemens Fin 2.75% 22-09.09.30	2.750	09.09.30	EUR	-	400 000	-200 000	200 000	191 830.40	0.22
Siemens Fin 2.875% 13-10.03.28	2.875	10.03.28	EUR	1 000 000	-	-500 000	500 000	492 137.00	0.57
Signify N.V 2.375% 20-11.05.27	2.375	11.05.27	EUR	300 000	-	-	300 000	276 730.06	0.32
Smithkline	1.375	02.12.24	EUR	500 000	-	-	500 000	483 934.50	0.56
Smiths Grou 2% 17-23.02.27	2.000	23.02.27	EUR	-	250 000	-	250 000	231 841.50	0.27
Snr 2.375% 22-06.04.28	2.375	06.04.28	EUR	600 000	-	-500 000	100 000	88 219.20	0.10
Socgen 7.875% 23-Perp	7.875	31.12.99	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Sodexo 1.0% 20-17.07.28	1.000	17.07.28	EUR	200 000	-	-	200 000	176 905.00	0.20
Sogecap Sa 4.125% /Frn 14-Perp	4.125	31.12.99	EUR	-	500 000	-400 000	100 000	95 350.17	0.11
Sse 2.875% 22-01.08.29 Regs	2.875	01.08.29	EUR	-	150 000	-	150 000	142 450.80	0.16
Sse 4.0% 22-Perp	4.000	31.12.99	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Stedin Hold 2.375% 03.06.30 Regs	2.375	03.06.30	EUR	600 000	-	-	600 000	552 351.53	0.64
Suez Sa 1.625% 19-Perp	1.625	31.12.99	EUR	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Swiss Life 4.375% 15-Perp	4.375	31.12.99	EUR	-	1 500 000	-200 000	1 300 000	1 272 723.69	1.46
Sydbank 4.75% 22-30.09.25	4.750	30.09.25	EUR	-	500 000	-	500 000	496 406.00	0.57
Telefonica	5.875	31.12.99	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Telefonica 1.201% 20-21.08.27	1.201	21.08.27	EUR	-	100 000	-	100 000	91 007.90	0.10
Telefonica 1.807% 20-21.05.32	1.807	21.05.32	EUR	-	100 000	-	100 000	85 391.40	0.10

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Telefonica 6.135% 23-Perp	6.135	31.12.99	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Telefonica 7.125% 22-Perp	7.125	31.12.99	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Telenor	2.625	06.12.24	EUR	500 000	-	-	500 000	490 042.00	0.56
Terna 2.375% 22-Perp	2.375	31.12.99	EUR	950 000	-	-950 000	-	-	0.00
Tor Dom 1.952% 22-08.04.30 B Regs	1.952	08.04.30	EUR	-	750 000	-	750 000	652 707.00	0.75
Totalen Cap 1.491% 20-08.04.27	1.491	08.04.27	EUR	-	500 000	-	500 000	461 894.50	0.53
Totalen Cap 1.618% 20-18.05.40	1.618	18.05.40	EUR	-	300 000	-	300 000	218 061.60	0.25
Totalenergies 2.0% 20-Perp	2.000	31.12.99	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Transurban 1.45% 19-16.05.29	1.450	16.05.29	EUR	500 000	-	-	500 000	435 592.50	0.50
Triodos Bk 2.25% 21-05.02.32	2.250	05.02.32	EUR	500 000	300 000	-800 000	-	-	0.00
Tyco Intl	1.375	25.02.25	EUR	600 000	-	-	600 000	563 901.00	0.65
Ubi 5.875% 20-Perp	5.875	31.12.99	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Ubisoft Ent 0.878% 20-24.11.27	0.878	24.11.27	EUR	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Ubs Group F 0.25% 21-03.11.26	0.250	03.11.26	EUR	-	500 000	-	500 000	445 840.50	0.51
Ubs Group F 4.625% 23-17.03.28	4.625	17.03.28	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Ubs Group F 4.75% 23-17.03.32	4.750	17.03.32	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Unibail Rod 2.125% 18-Perp	2.125	31.12.99	EUR	1 300 000	900 000	-2 200 000	-	-	0.00
Unilev Cap 3.40% 23-06.06.33	3.400	06.06.33	EUR	-	200 000	-	200 000	196 933.40	0.23
Unilever 1.375% 18-04.09.30	1.375	04.09.30	EUR	-	400 000	-	400 000	347 512.02	0.40
Verizon Com 0.375% 21-22.03.29	0.375	22.03.29	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Verizon Com 0.75% 21-22.03.32	0.750	22.03.32	EUR	-	100 000	-	100 000	76 576.50	0.09
Verizon Com 1.375% 16-02.11.28	1.375	02.11.28	EUR	-	100 000	-	100 000	87 823.50	0.10
Vestas Wind 2.0% 22-15.06.34	2.000	15.06.34	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Virgin Mney 2.875% 20-24.06.25	2.875	24.06.25	EUR	750 000	-	-750 000	-	-	0.00
Vivat Nv 7% 18-Perp Regs	7.000	31.12.99	EUR	-	500 000	-	500 000	473 168.00	0.54
Vodafone 2.625% 20-27.08.80	2.625	27.08.80	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Vodafone In 3.25% 22-02.03.29	3.250	02.03.29	EUR	-	200 000	-	200 000	194 268.00	0.22
Vodafone In 3.75% 22-02.12.34	3.750	02.12.34	EUR	-	200 000	-	200 000	194 012.80	0.22
Volksbank 4.75% 23-15.03.27	4.750	15.03.27	EUR	-	800 000	-	800 000	788 022.85	0.91
Volksbank 7.75% 19-Perp	7.750	31.12.99	EUR	2 000 000	400 000	-2 400 000	-	-	0.00
Wolters Klu 0.75% 20-03.07.30	0.750	03.07.30	EUR	300 000	-	-	300 000	247 446.90	0.28
Zuercher Kb 0.0% 21-15.05.26	0.000	15.05.26	EUR	2 000 000	-	-1 800 000	200 000	179 314.20	0.21
								79 810 212.54	91.78

Indexoptionen

Euro Bund	24.02.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	26.08.22	EUR	-	200	-200	-	-	0.00
Euro Bund	26.08.22	EUR	-	280	-280	-	-	0.00
Euro Bund	26.08.22	EUR	-	50	-50	-	-	0.00
Euro Bund	26.08.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	26.08.22	EUR	-	75	-75	-	-	0.00
Euro Bund	23.09.22	EUR	-	50	-50	-	-	0.00
Euro Bund	25.11.22	EUR	-	75	-75	-	-	0.00
Euro Bund	25.11.22	EUR	-	75	-75	-	-	0.00
Euro Bund	21.10.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	25.11.22	EUR	-	75	-75	-	-	0.00
								0.00

Schatzwechsel

Deutschland 0% 13.04.23 Tb	13.04.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Deutschland 0% 21.06.23 Tb Regs	21.06.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Deutschland 0% 21-14.12.22 Tb	14.12.22	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Deutschland 0% 22.02.23 Tb	22.02.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Deutschland 0% 22-18.01.23 Tb	18.01.23	EUR	-	200	-200	-	-	0.00
Deutschland 0% 22-19.07.23 Tb	19.07.23	EUR	-	100	-	100	99.86	0.00
Deutschland 0% 23-13.12.23 Tb	13.12.23	EUR	-	100	-	100	98.44	0.00
Deutschland 0% 23-15.05.24 Tb	15.05.24	EUR	-	100	-	100	96.91	0.00
Deutschland 0% 23-17.01.24 Tb	17.01.24	EUR	-	100	-	100	98.13	0.00
Deutschland 0% 23-19.06.24 Tb	19.06.24	EUR	-	100	-	100	96.60	0.00

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Deutschland 0% 23-20.03.24 Tb		20.03.24	EUR	-	100	-	100	97.51	0.00
Deutschland 0% 23-21.02.24 Tb		21.02.24	EUR	-	100	-	100	97.77	0.00
Germany 0% 22-22.03.23 Tb		22.03.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
								685.22	0.00

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind **79 810 897.76** **91.78**

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Aviva 0.625 16-27.10.23	0.625	27.10.23	EUR	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Banca Ifis 6.125% 23-19.01.27	6.125	19.01.27	EUR	-	600 000	-	600 000	600 915.60	0.69
Bpce 4.125% 23-10.07.28	4.125	10.07.28	EUR	-	200 000	-	200 000	200 027.00	0.23
Bqe Postale 0.75% 21-23.06.31	0.750	23.06.31	EUR	600 000	-	-	600 000	459 145.20	0.53
Met Tenerif 1.229% 21-30.07.36	1.229	30.07.36	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Orsted 5.25% 22-08.12.22	5.250	08.12.22	EUR	-	200 000	-	200 000	199 241.60	0.23
Seb	1.375	31.10.28	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	986 919.00	1.13
Socgen 4.25% 22-06.12.30	4.250	06.12.30	EUR	-	800 000	-	800 000	774 300.00	0.89
Spbk Bolikr 0.05% 21-03.11.28	0.050	03.11.28	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Takeda Phar 1.375% 20-09.07.32	1.375	09.07.32	EUR	1 000 000	-	-400 000	600 000	483 103.20	0.56
Vr-Group Pl 2.375% 22-30.05.29	2.375	30.05.29	EUR	1 400 000	-	-	1 400 000	1 279 123.16	1.47
								4 982 774.76	5.73

Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere **4 982 774.76** **5.73**

SUMME WERTPAPIERBESTAND **84 793 672.52** **97.51**

Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen **1 739 145.99** **2.00**

Sonstige Aktiven **429 718.09** **0.49**

GESAMTNETTOVERMÖGEN **86 962 536.60** **100.00**

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Europe

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Air Liquide			EUR	7 810	-	-	7 810	1 282 402.00	3.40
Aker Bp Asa			NOK	-	24 048	-24 048	-	-	0.00
Aker Bp Asa			SEK	-	18 068	-18 068	-	-	0.00
Alcon Inc.			CHF	13 650	-	-13 650	-	-	0.00
Allianz Se /Nam.Vinkuliert			EUR	6 400	-	-870	5 530	1 178 996.00	3.13
Amadeus It – Shs-A-			EUR	-	17 000	-	17 000	1 184 900.00	3.14
Anheuser-Busch Inbev Sa/Nv			EUR	10 830	-	-10 830	-	-	0.00
Antofagasta Plc			GBP	51 500	-	-	51 500	876 794.51	2.32
Asml Holding Nv			EUR	3 290	-	-	3 290	2 181 270.00	5.78
Astrazeneca Plc			GBP	-	8 400	-	8 400	1 103 760.20	2.93
Atlas Copco Rg-A			SEK	84 452	-	-	84 452	1 113 673.97	2.95
Bankinter Sa			EUR	150 000	-	-25 000	125 000	703 750.00	1.87
Befesa S.A.			EUR	12 350	-	-	12 350	432 250.00	1.15
Berkeley Grp Rg			GBP	15 699	-	-	15 699	717 679.72	1.90
Coca-Cola Hbc			GBP	27 900	-	-13 500	14 400	393 500.89	1.04
Cond Hldgs Rg-Unty			GBP	100 000	-	-	100 000	537 206.55	1.42
Deutsche Post Ag			EUR	23 700	-	-	23 700	1 060 101.00	2.81
Drax Group Plc			GBP	85 000	-	-	85 000	574 496.38	1.52
E.On - Namen Akt.			EUR	92 000	-	-92 000	-	-	0.00
Elis Sa			EUR	59 150	-	-59 150	-	-	0.00
Essilor International			EUR	5 600	-	-600	5 000	863 000.00	2.29
Glaxosmithkline Plc			GBP	65 000	-	-65 000	-	-	0.00
Gsk Plc			GBP	-	52 000	-	52 000	841 556.79	2.23
Haleon Rg			GBP	-	65 000	-65 000	-	-	0.00
Hitesa Sanpaolo Spa			EUR	277 000	-	-277 000	-	-	0.00
Julius Baer Grp *Opr*			CHF	16 500	-	-1 850	14 650	845 622.88	2.24
L Oreal			EUR	3 300	-	-	3 300	1 409 430.00	3.74
Logitech Intl Sa			CHF	-	13 298	-	13 298	725 348.36	1.92
Lundin Petroleum Ab			SEK	19 000	-	-19 000	-	-	0.00
Lvmh Act.			EUR	2 400	-	-	2 400	2 071 200.00	5.49
Neste Oil Oyj			EUR	19 800	-	-	19 800	698 148.00	1.85
Nestle / Act Nom			CHF	14 100	3 910	-	18 010	1 985 401.03	5.26
Nordea Bank Abp			SEK	134 000	-	-	134 000	1 333 828.30	3.54
Novo Nordisk A/S /-B-			DKK	7 700	-	-1 050	6 650	981 880.04	2.60
Omv Ag			EUR	10 700	-	-10 700	-	-	0.00
Osb Grp Rg			GBP	125 947	-	-	125 947	704 481.25	1.87
Puma Se			EUR	11 750	-	-	11 750	647 660.00	1.72
Qiagen N.V.			EUR	10 800	-	-	10 800	444 312.00	1.18
Reckitt Benckiser Group Plc			GBP	13 600	-	-	13 600	936 944.16	2.48
Roche Holding Ag /Genussschein			CHF	4 500	750	-2 550	2 700	756 559.96	2.01
Sap Se			EUR	8 700	-	-8 700	-	-	0.00
Schneider Electric Se			EUR	-	8 000	-	8 000	1 331 680.00	3.53
Shell Rg Registered Shs			GBP	-	40 500	-	40 500	1 105 541.37	2.93
Sig Combibloc Group Ag			CHF	-	36 440	-	36 440	921 394.86	2.44
Sika Ltd			CHF	3 580	-	-	3 580	937 855.68	2.49
Straumann Hldg N			CHF	-	2 340	-	2 340	347 980.70	0.92
Stroeer Akt			EUR	6 100	-	-	6 100	271 450.00	0.72
Swiss Life Holding /Nam			CHF	2 200	-	-700	1 500	803 739.31	2.13
Ucb			EUR	9 200	-	-	9 200	747 040.00	1.98
Univ Mu Gr Br Rg			EUR	39 000	5 690	-	44 690	909 441.50	2.41
Upm-Kymmene Corp			EUR	27 500	-	-27 500	-	-	0.00

JSS Sustainable Equity - Europe (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Vinci			EUR	14 000	-	-7 080	6 920	736 149.60	1.95
Weir Group Plc			GBP	43 000	-	-	43 000	879 900.05	2.33
								37 578 327.06	99.61
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								37 578 327.06	99.61
SUMME WERTPAPIERBESTAND								37 578 327.06	99.61
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								235 333.26	0.62
Sonstige Passiven								-88 526.40	-0.23
GESAMTNETTOVERMÖGEN								37 725 133.92	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

Abbott Laboratories Inc			USD	-	9 666	-	9 666	965 891.22	1.10
Allianz Se /Nam.Vinkuliert			EUR	8 781	409	-925	8 265	1 762 098.00	2.00
Ally Financial Inc			USD	48 748	2 270	-51 018	-	-	0.00
Alphabet Inc -A-			USD	1 555	30 518	-3 788	28 285	3 103 313.02	3.53
American Water Works Co Inc			USD	12 023	560	-1 267	11 316	1 480 622.36	1.68
Ameriprise Financ. /Wh.I			USD	-	3 765	-66	3 699	1 126 177.67	1.28
Apple Inc			USD	-	6 948	-478	6 470	1 150 307.88	1.31
Applied Materials Inc			USD	11 968	-	-11 968	-	-	0.00
Aptiv Plc			USD	13 659	-	-13 659	-	-	0.00
Arch Capital Gp Ltd Bermuda			USD	44 057	2 051	-5 847	40 261	2 762 177.68	3.14
Arista Networks Inc			USD	14 804	689	-1 559	13 934	2 069 792.89	2.35
Asm International Reg Nv			EUR	-	4 349	-377	3 972	1 542 526.20	1.75
Astrazeneca Plc			GBP	-	12 533	-	12 533	1 646 836.50	1.87
Autodesk Inc.			USD	4 885	227	-5 112	-	-	0.00
Avery Dennison Corp			USD	-	8 959	-617	8 342	1 313 616.50	1.49
Bristol Myers Squibb Co			USD	32 027	1 118	-33 145	-	-	0.00
Cadence Design Systems			USD	19 471	907	-8 170	12 208	2 624 216.46	2.98
Carrier Global Corporation			USD	49 280	2 294	-5 191	46 383	2 113 381.24	2.40
Cme Group Inc			USD	4 902	228	-5 130	-	-	0.00
Coca-Cola Co.			USD	-	39 847	-695	39 152	2 161 075.56	2.46
Colgate-Palmolive Co.			USD	28 948	1 348	-3 049	27 247	1 924 022.80	2.19
Danaher Corp			USD	8 264	299	-4 470	4 093	900 384.97	1.02
Dong Energy A/S			DKK	10 219	-	-10 219	-	-	0.00
Dsm-Firmenich Ltd			EUR	-	8 823	-	8 823	870 124.26	0.99
Edwards Lifesciences			USD	-	13 664	-13 664	-	-	0.00
Eisai Co.Ltd			JPY	20 300	8 700	-2 573	26 427	1 629 652.75	1.85
Estee Lauder Co -A-			USD	6 547	305	-6 852	-	-	0.00
Ferguson Newco Plc			USD	-	10 581	-	10 581	1 525 661.88	1.74
Flextronics Intl Ltd			USD	111 605	5 196	-33 830	82 971	2 102 033.40	2.39
Fortive Corp			USD	30 631	1 426	-3 227	28 830	1 975 819.52	2.25
Gilead Sciences Inc.			USD	-	19 227	-336	18 891	1 334 490.71	1.52
Global Payments Inc			USD	-	17 821	-17 821	-	-	0.00
Globus Medical Inc -A-			USD	19 736	919	-20 655	-	-	0.00
Hera Spa			EUR	467 475	-	-467 475	-	-	0.00
Hologic Inc			USD	-	13 197	-230	12 967	962 362.96	1.09
Home Depot Inc.			USD	-	6 154	-6 154	-	-	0.00
Hydro One Ltd			CAD	-	33 392	-2 299	31 093	815 195.55	0.93
Infineon Technologies /Nam.			EUR	57 506	2 678	-6 058	54 126	2 045 150.91	2.33
Kilroy Realty Corporation			USD	23 694	-	-23 694	-	-	0.00
Kingspan Group Plc			EUR	19 825	-	-19 825	-	-	0.00
Koninklijke Dsm Nv			EUR	9 210	429	-9 639	-	-	0.00
Lkq			USD	38 050	1 772	-4 007	35 815	1 912 868.97	2.18
Lowe S Companies Inc.			USD	10 207	8 668	-10 358	8 517	1 761 949.50	2.00
Mastercard Inc. Shs-A-			USD	5 149	240	-542	4 847	1 747 319.07	1.99
Microsoft Corp			USD	17 393	810	-1 912	16 291	5 085 001.96	5.78
Motorola Soltn /Ex-Distr			USD	9 523	443	-1 003	8 963	2 409 412.14	2.74
National Grid Plc			GBP	-	97 831	-8 475	89 356	1 083 443.28	1.23
Nexon Co Ltd			JPY	32 980	-	-32 980	-	-	0.00
Nike Inc -B-			USD	-	13 339	-919	12 420	1 256 457.75	1.43
Nordea Bank Abp			SEK	188 649	8 785	-19 874	177 560	1 767 422.04	2.01
Nvidia Corp.			USD	3 588	170	-3 758	-	-	0.00
Owens Corning Inc			USD	18 844	877	-1 985	17 736	2 121 492.21	2.41
Pnc Financial Services Gp			USD	12 803	596	-1 349	12 050	1 391 106.78	1.58
Power Integrations Inc			USD	17 138	9 718	-1 960	24 896	2 160 315.60	2.46

JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Reckitt Benckiser Group Plc			GBP	20 285	945	-2 137	19 093	1 315 373.16	1.50
Reinsurance Grp America Inc			USD	11 572	539	-1 219	10 892	1 384 611.81	1.57
Schneider Electric Se			EUR	19 491	907	-2 059	18 339	3 052 709.94	3.47
Sealed Air Corp (New)			USD	55 545	1 800	-20 952	36 393	1 334 298.81	1.52
Servicenow Inc			USD	-	2 349	-2 349	-	-	0.00
Shimano Inc.			JPY	10 063	4 211	-1 165	13 109	1 991 859.21	2.27
Smith And Nephew Plc			GBP	96 385	-	-96 385	-	-	0.00
Solaredge Technologies Inc			USD	3 091	144	-326	2 909	717 384.46	0.82
Stantec Inc			CAD	64 742	3 017	-8 878	58 881	3 527 559.65	4.01
Tesla Mtrs			USD	1 926	4 059	-547	5 438	1 304 771.09	1.48
Tetra Tech Inc.			USD	7 569	352	-798	7 123	1 069 037.60	1.22
T-Mobile Us Inc			USD	-	10 383	-10 383	-	-	0.00
Ucb			EUR	16 010	6 066	-1 687	20 389	1 655 586.80	1.88
Unicharm Corp			JPY	41 200	2 000	-4 372	38 828	1 315 133.56	1.50
Unitedhealth Group Inc			USD	4 979	232	-5 211	-	-	0.00
Vertex Pharmaceuticals			USD	-	3 949	-342	3 607	1 163 464.13	1.32
Vestas Wind Br/Rg			DKK	37 125	1 731	-3 912	34 944	851 597.89	0.97
Workday Inc - Class A			USD	-	9 260	-162	9 098	1 883 727.97	2.14
								87 170 838.27	99.12
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								87 170 838.27	99.12
SUMME WERTPAPIERBESTAND								87 170 838.27	99.12
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								806 258.86	0.92
Sonstige Passiven								-30 625.65	-0.04
GESAMTNETTOVERMÖGEN								87 946 471.48	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Real Estate Global

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

Ado Properties S.A. /Reit			EUR	32 058	6 307	-38 365	-	-	0.00
Alexandria Real Estate Eq.			USD	10 541	4 224	-6 186	8 579	892 420.45	2.94
American Tower Corp			USD	2 741	539	-	3 280	583 064.34	1.92
Avalonbay Communities Inc.			USD	4 101	807	-	4 908	851 454.78	2.81
Boston Properties			USD	9 426	1 854	-	11 280	595 430.98	1.96
Camden Property Tr./Benef.Int.			USD	6 937	2 065	-	9 002	898 302.24	2.96
City Developments Ltd			SGD	188 500	90 400	-93 500	185 400	843 808.77	2.78
Ck Asset Hldgs			HKD	131 000	25 500	-32 500	124 000	629 444.96	2.08
Cofinimmo Sa			EUR	-	4 547	-	4 547	312 833.60	1.03
Crown Castle International Shs			USD	3 748	2 007	-	5 755	601 030.89	1.98
Ctp Br Rg			EUR	113 132	31 136	-10 817	133 451	1 588 066.90	5.24
Derwent London Plc Reit			GBP	19 685	19 038	-	38 723	925 045.80	3.05
Equinix Inc /Reit			USD	2 450	481	-1 541	1 390	998 786.98	3.29
Equity Residential Sbi			USD	12 742	2 506	-	15 248	922 007.85	3.04
Essex Property Trust			USD	2 967	823	-	3 790	813 929.42	2.69
Gecina /Act.Nom.			EUR	9 005	1 772	-10 777	-	-	0.00
Goodman Group			AUD	116 558	21 816	-5 608	132 766	1 625 756.24	5.36
Healthpeak Properties Inc /Reit			USD	41 523	18 184	-	59 707	1 100 009.81	3.63
Hysan Development Co			HKD	-	370 000	-	370 000	827 438.94	2.73
Kilroy Realty Corporation			USD	16 574	4 798	-	21 372	589 444.07	1.94
Leg Immobilien			EUR	14 614	6 770	-	21 384	1 125 653.76	3.71
Life Storage Inc /Reit			USD	10 664	2 098	-9 006	3 756	457 743.13	1.51
Mid-America Apartment Commun.			USD	6 113	1 202	-	7 315	1 018 199.73	3.36
Mitsubishi Estate Co.			JPY	79 200	35 300	-15 300	99 200	1 075 746.75	3.55
Mitsui Fudosan Co			JPY	55 000	27 800	-10 400	72 400	1 313 356.95	4.33
Prologis Inc			USD	23 166	4 388	-4 369	23 185	2 606 028.00	8.59
Public Storage			USD	2 566	504	-	3 070	821 330.52	2.71
Segro Plc /Reit			GBP	58 285	70 716	-	129 001	1 077 535.16	3.55
Sino Land Co Ltd			HKD	478 000	94 000	-	572 000	644 271.11	2.13
The Link Reit			HKD	113 300	49 540	-	162 840	828 507.98	2.73
Unite Group Plc /Reit			GBP	-	40 556	-	40 556	411 163.68	1.36
Vonovia Se /Namen			EUR	55 480	23 121	-10 303	68 298	1 222 192.71	4.03
Welltower Inc /Reit			USD	6 601	1 298	-	7 899	585 655.46	1.93
							28 785 661.96	94.92	

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

28 785 661.96 94.92

Sonstige übertragbare Wertpapiere

Aktien

Bgp Holdings			AUD	2 133 352	-	-2 133 352	-	-	0.00
									0.00

JSS Sustainable Equity - Real Estate Global (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Anleihen									
Right The Link 21.03.23 /Sous	0.000		HKD	-	27 140	-27 140	-	-	0.00
								-	0.00
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere								-	0.00
SUMME WERTPAPIERBESTAND								28 785 661.96	94.92
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								1 562 414.48	5.15
Sonstige Passiven								-21 136.04	-0.07
GESAMTNETTOVERMÖGEN								30 326 940.40	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - USA

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

Abbott Laboratories Inc			USD	-	37 800	-	37 800	4 120 956.00	2.28
Activision Blizzard Inc			USD	23 148	22 707	-4 549	41 306	3 482 095.80	1.92
Ally Financial Inc			USD	68 437	1 395	-69 832	-	-	0.00
Alphabet Inc -C-			USD	4 203	89 914	-19 663	74 454	9 006 700.38	4.98
Amazon Com Inc			USD	45 760	6 169	-11 394	40 535	5 284 142.60	2.92
American Tower Corp			USD	20 416	2 039	-9 052	13 403	2 599 377.82	1.44
Ameriprise Financ. /Wh.I			USD	-	11 186	-1 542	9 644	3 203 351.04	1.77
Apple Inc			USD	67 388	9 081	-16 796	59 673	11 574 771.81	6.39
Applied Materials Inc			USD	32 493	14 256	-9 185	37 564	5 429 500.56	3.00
Aptiv Plc			USD	23 820	-	-23 820	-	-	0.00
Arch Capital Gp Ltd Bermuda			USD	113 373	12 192	-49 084	76 481	5 724 602.85	3.16
Arista Networks Inc			USD	29 096	5 624	-7 603	27 117	4 394 581.02	2.43
Avantor Inc			USD	94 812	1 932	-96 744	-	-	0.00
Avery Dennison Corp			USD	-	12 784	-12 784	-	-	0.00
Biogen Inc			USD	-	13 281	-2 580	10 701	3 048 179.85	1.68
Booking Holdings Inc			USD	-	1 085	-34	1 051	2 838 046.83	1.57
Bristol Myers Squibb Co			USD	54 270	1 106	-55 376	-	-	0.00
Cadence Design Systems			USD	30 783	4 149	-7 668	27 264	6 393 953.28	3.53
Calix Networks			USD	-	41 717	-575	41 142	2 053 397.22	1.13
Carrier Global Corporation			USD	111 012	14 962	-27 655	98 319	4 887 437.49	2.70
Cme Group Inc			USD	14 415	-	-14 415	-	-	0.00
Coca-Cola Co.			USD	-	78 161	-3 866	74 295	4 474 044.90	2.47
Colgate-Palmolive Co.			USD	45 110	6 080	-11 238	39 952	3 077 902.08	1.70
Conocophillips			USD	40 571	5 468	-10 108	35 931	3 722 810.91	2.06
Deere & Co.			USD	11 859	1 599	-2 955	10 503	4 255 710.57	2.35
Edwards Lifesciences			USD	32 290	658	-32 948	-	-	0.00
Estee Lauder Co -A-			USD	11 466	234	-11 700	-	-	0.00
Ferguson Newco Plc			USD	-	19 746	-	19 746	3 106 243.26	1.72
Flextronics Intl Ltd			USD	176 558	23 806	-43 923	156 441	4 324 029.24	2.39
Gilead Sciences Inc.			USD	-	41 475	-1 286	40 189	3 097 366.23	1.71
Global Payments Inc			USD	-	36 828	-6 088	30 740	3 028 504.80	1.67
Globus Medical Inc -A-			USD	46 449	947	-47 396	-	-	0.00
Hess Corp			USD	27 661	3 729	-6 891	24 499	3 330 639.05	1.84
Hologic Inc			USD	-	30 749	-953	29 796	2 412 582.12	1.33
Intra-Cellular Therapies Inc			USD	49 840	-	-49 840	-	-	0.00
Lilly (Eli) & Co			USD	8 000	1 078	-1 992	7 086	3 323 192.28	1.84
Lkq			USD	67 969	9 161	-16 933	60 197	3 507 679.19	1.94
Lowe S Companies Inc.			USD	17 793	2 399	-4 432	15 760	3 557 032.00	1.96
Mastercard Inc. Shs-A-			USD	16 851	1 450	-9 211	9 090	3 575 097.00	1.97
Microsoft Corp			USD	60 364	7 916	-22 169	46 111	15 702 639.94	8.67
Mondelez International Inc Wi			USD	67 851	9 144	-16 912	60 083	4 382 454.02	2.42
Motorola Soltn/Ex-Distr			USD	20 086	2 388	-7 151	15 323	4 493 929.44	2.48
Nike Inc B			USD	27 369	3 689	-6 817	24 241	2 675 479.17	1.48
Nvidia Corp.			USD	11 685	238	-11 923	-	-	0.00
Owens Corning Inc			USD	35 958	4 847	-8 958	31 847	4 156 033.50	2.30
Pnc Financial Services Gp			USD	39 522	5 326	-9 845	35 003	4 408 627.85	2.44
Power Integrations Inc			USD	36 430	21 010	-10 852	46 588	4 410 485.96	2.44
Reinsurance Grp America Inc			USD	22 042	2 971	-5 491	19 522	2 707 506.18	1.50
Sealed Air Corp (New)			USD	93 974	10 085	-37 798	66 261	2 650 440.00	1.46
Tesla Mtrs			USD	3 395	13 819	-17 214	-	-	0.00
T-Mobile Us Inc			USD	29 301	597	-29 898	-	-	0.00
United Rentals Inc.			USD	9 716	198	-9 914	-	-	0.00
Unitedhealth Group Inc			USD	8 336	1 124	-2 077	7 383	3 548 565.12	1.96

JSS Sustainable Equity - USA (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Vertex Pharmaceuticals			USD	14 117	1 350	-6 596	8 871	3 121 793.61	1.72
Workday Inc - Class A			USD	-	19 782	-2 181	17 601	3 975 889.89	2.20
							179 067 772.86	98.92	
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								179 067 772.86	98.92
SUMME WERTPAPIERBESTAND								179 067 772.86	98.92
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								2 019 925.17	1.12
Sonstige Passiven								-60 301.30	-0.04
GESAMTNETTOVERMÖGEN								181 027 396.73	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
3I Group Plc			GBP	-	19 409	-	19 409	440 700.92	0.22
3M Co			USD	1 407	4 959	-3 609	2 757	252 931.37	0.13
A.P. Moeller - Maersk A/S B			DKK	-	41	-41	-	-	0.00
Accenture Plc			USD	674	2 469	-2 538	605	171 119.07	0.09
Acciona Sa /Esp 167			EUR	-	1 766	-1 766	-	-	0.00
Activision Blizzard Inc			USD	-	12 370	-4 178	8 192	632 984.05	0.32
Adecco Group Sa /Act.Nom.			CHF	8 093	8 915	-8 093	8 915	266 976.12	0.14
Adobe Systems			USD	477	914	-959	432	193 623.90	0.10
Advance Auto Parts Inc			USD	-	4 695	-512	4 183	269 537.03	0.14
Aecom			USD	-	5 517	-5 517	-	-	0.00
Aegon Nv			EUR	58 627	-	-58 627	-	-	0.00
Aercap Holdings Nv			USD	6 182	4 785	-6 182	4 785	278 591.38	0.14
Aflac Inc.			USD	8 665	-	-8 665	-	-	0.00
Agilent Technologies			USD	-	2 421	-2 421	-	-	0.00
Aib Group Plc			EUR	-	111 270	-	111 270	428 389.50	0.22
Air Liquide			EUR	-	5 120	-4 013	1 107	181 769.40	0.09
Ajinomoto Co. Inc			JPY	-	11 500	-11 500	-	-	0.00
Akamai Technologies Inc			USD	-	5 152	-5 152	-	-	0.00
Allegion Plc			USD	1 781	2 152	-3 933	-	-	0.00
Allstate Corp			USD	-	723	-723	-	-	0.00
Ally Financial Inc			USD	7 230	10 015	-7 230	10 015	247 942.39	0.13
Alnylam Pharmaceuticals Inc			USD	-	2 447	-	2 447	426 015.75	0.22
Alphabet Inc -A-			USD	88	6 278	-1 076	5 290	580 396.88	0.30
Alphabet Inc -C-			USD	86	5 176	-3 757	1 505	166 874.29	0.08
Amc Entert -A -/Pfd			USD	-	29 187	-29 187	-	-	0.00
Amc Entertainment Holdings Inc			USD	39 535	14 618	-54 153	-	-	0.00
Amcor – Registered Shs			USD	38 332	-	-38 332	-	-	0.00
American Express Co.			USD	3 063	-	-3 063	-	-	0.00
American Water Works Co Inc			USD	1 318	1 387	-2 705	-	-	0.00
Ametek Inc			USD	-	6 219	-4 969	1 250	185 472.04	0.09
Amgen Inc			USD	-	3 314	-3 314	-	-	0.00
Amphenol Corporation -A-			USD	7 218	954	-8 172	-	-	0.00
Analog Devices Inc			USD	3 095	-	-3 095	-	-	0.00
Annaly Cap /Reit			USD	-	17 722	-3 310	14 412	264 330.08	0.13
Annaly Capital Management Inc			USD	46 819	-	-46 819	-	-	0.00
Anthem Inc			USD	620	1 265	-1 285	600	244 339.14	0.12
Anz Banking Group			AUD	-	6 118	-6 118	-	-	0.00
Aon Plc -A-			USD	-	2 854	-2 254	600	189 844.18	0.10
Apple Inc			USD	4 865	1 234	-5 058	1 041	185 080.45	0.09
Applied Materials Inc			USD	-	4 411	-912	3 499	463 561.37	0.24
Aramark Holdings Corp			USD	-	12 904	-12 904	-	-	0.00
Arc Resources Ltd			CAD	-	36 136	-21 103	15 033	183 999.02	0.09
Arch Capital Gp Ltd Bermuda			USD	4 460	21 026	-16 185	9 301	638 111.69	0.32
Archer-Daniels Midland Co			USD	-	8 105	-4 178	3 927	271 974.45	0.14
Argen-X N.V.			EUR	-	2 016	-844	1 172	416 528.80	0.21
Arista Networks Inc			USD	4 954	2 899	-4 954	2 899	430 625.06	0.22
Aristocrat Leisure Limited			AUD	8 358	14 948	-23 306	-	-	0.00
Arrow Electronics Inc.			USD	6 635	2 194	-6 635	2 194	288 035.40	0.15
Asahi Glass Co. Ltd			JPY	7 900	-	-7 900	-	-	0.00
Asml Holding Nv			EUR	-	696	-434	262	173 706.00	0.09
Assurant Inc			USD	-	540	-540	-	-	0.00
Astrazeneca Plc			GBP	-	6 092	-2 846	3 246	426 524.48	0.22
At & T			USD	14 666	41 224	-37 309	18 581	271 647.07	0.14
Atlas Copco Rg-A			SEK	18 068	23 793	-41 861	-	-	0.00

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Atlas Copco Rg-B			SEK	-	39 220	-24 335	14 885	169 574.38	0.09
Atmos Energy Corp			USD	-	7 695	-3 582	4 113	438 594.34	0.22
Auto Trader Group Plc			GBP	28 488	49 661	-53 417	24 732	175 919.57	0.09
Automatic Data Proces.			USD	2 305	538	-1 973	870	175 267.92	0.09
Avalonbay Communities Inc.			USD	1 009	1 912	-1 881	1 040	180 422.36	0.09
Avantor Inc			USD	-	4 152	-4 152	-	-	0.00
Avery Dennison Corp			USD	1 138	3 173	-4 311	-	-	0.00
Axon Enterprise			USD	-	2 437	-	2 437	435 845.50	0.22
Baker Hughes A Ge Company			USD	13 721	17 544	-15 341	15 924	461 372.72	0.23
Baloise Holding /Namen			CHF	-	602	-602	-	-	0.00
Bank Of Montreal			CAD	4 687	147	-4 834	-	-	0.00
Bank Of Ny Mellon Corp Shs			USD	6 690	6 613	-6 690	6 613	269 854.04	0.14
Barratt Devel.Plc			GBP	48 695	4 777	-53 472	-	-	0.00
Barry Callebaut Ag /Nam.			CHF	-	433	-204	229	405 181.94	0.21
Bath&Body Works Rg			USD	-	9 945	-2 450	7 495	257 619.16	0.13
Bausch Health Rg Registered Shs			CAD	-	12 772	-12 772	-	-	0.00
Bco Bilbao Viz.Argentaria/Nam.			EUR	57 533	40 689	-57 533	40 689	286 125.05	0.15
Becton Dickinson & Co.			USD	-	2 103	-2 103	-	-	0.00
Beiersdorf A.G.			EUR	-	3 654	-	3 654	443 047.50	0.23
Best Buy Co Inc.			USD	3 957	3 860	-3 957	3 860	289 942.25	0.15
Biogen Inc			USD	1 542	-	-1 542	-	-	0.00
Biomarin Pharmaceutical Inc			USD	6 608	-	-6 608	-	-	0.00
Black Knight Holdco Corp			USD	-	8 479	-8 479	-	-	0.00
Blackrock Inc			USD	-	691	-	691	437 743.12	0.22
Blackstone Group Inc Npv Cl A			USD	4 312	-	-4 312	-	-	0.00
Bmw Ag /Vorzug.			EUR	-	5 061	-2 396	2 665	277 693.00	0.14
Bmw-Bayer.Motorenwerke			EUR	3 510	2 504	-3 510	2 504	281 750.08	0.14
Boc Hong Kong Holdings Ltd			HKD	-	92 000	-	92 000	257 715.00	0.13
Booking Holdings Inc			USD	-	345	-94	251	621 249.16	0.32
Bouygues			EUR	-	13 086	-13 086	-	-	0.00
Brdrdg Fncl Solutions /Wh.Iss.			USD	-	3 052	-3 052	-	-	0.00
Bristol Myers Squibb Co			USD	4 048	4 829	-4 573	4 304	252 283.04	0.13
Broadcom Inc			USD	902	724	-1 394	232	184 458.08	0.09
Brookfield Asset Mgmt -A-/Ltd			USD	-	7 800	-7 800	-	-	0.00
Brown & Brown Inc			USD	-	12 425	-5 041	7 384	465 916.19	0.24
Brwn-Frman Corp. B /Non-Vot			USD	3 137	4 086	-7 223	-	-	0.00
Bunge Ltd			USD	-	3 870	-807	3 063	264 889.14	0.13
Bunzl Plc			GBP	14 901	8 631	-23 532	-	-	0.00
Burberry Group Plc			GBP	-	14 176	-7 188	6 988	172 635.11	0.09
Bureau Veritas			EUR	-	15 863	-15 863	-	-	0.00
C.H.Robinson Worldwide Inc			USD	-	3 223	-3 223	-	-	0.00
Cable One Inc			USD	398	55	-453	-	-	0.00
Cadence Design Systems			USD	4 458	1 422	-5 060	820	176 266.18	0.09
Camden Property Tr./Benef.Int.			USD	5 072	2 087	-5 408	1 751	174 730.86	0.09
Campbell Soup Co.			USD	6 594	6 734	-13 328	-	-	0.00
Canad.Imper.Bk Of Commerce			CAD	-	6 620	-	6 620	259 358.62	0.13
Canadian T.Corp A N-Vot.			CAD	2 256	-	-2 256	-	-	0.00
Canon Inc.			JPY	20 300	20 200	-40 500	-	-	0.00
Capcom Co Ltd			JPY	8 000	18 100	-14 700	11 400	411 718.93	0.21
Capgemini Se			EUR	2 681	-	-2 681	-	-	0.00
Carlsberg As B			DKK	2 476	-	-2 476	-	-	0.00
Cbre Group -A-			USD	2 562	3 698	-6 260	-	-	0.00
Centene Corp. De			USD	9 919	4 548	-10 214	4 253	262 937.53	0.13
Check Point Software Techno			USD	4 006	4 989	-7 476	1 519	174 900.81	0.09
Chubb Ltd			USD	2 419	2 002	-4 421	-	-	0.00
Cigna Corporation			USD	1 182	3 547	-3 629	1 100	282 914.76	0.14
Cincinnati Financial Corp			USD	1 610	2 160	-3 770	-	-	0.00
Cisco Systems Inc.			USD	6 803	16 307	-13 693	9 417	446 595.40	0.23
Citizens Financial Group Inc			USD	7 628	10 170	-7 628	10 170	243 110.54	0.12

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Citrix Systems Inc			USD	-	941	-941	-	-	0.00
Ck Asset Hldgs			HKD	-	14 500	-14 500	-	-	0.00
Clarivate Rg Shs			USD	-	35 284	-	35 284	308 209.46	0.16
Clorox Co			USD	-	2 919	-	2 919	425 515.82	0.22
Cme Group Inc			USD	2 548	2 601	-5 149	-	-	0.00
Cms Energy Corp.			USD	-	7 653	-7 653	-	-	0.00
Coca-Cola Co.			USD	-	7 103	-7 103	-	-	0.00
Coca-Cola Europ Prntr			USD	5 752	7 420	-5 752	7 420	438 194.87	0.22
Coca-Cola Hbc			GBP	-	15 898	-	15 898	434 435.91	0.22
Cognex Corp			USD	4 247	4 512	-8 759	-	-	0.00
Cognizant Technology Sol A			USD	4 185	7 384	-7 136	4 433	265 248.62	0.13
Colgate-Palmolive Co.			USD	2 626	9 367	-9 515	2 478	174 981.78	0.09
Comcast Corp/-A-			USD	7 273	19 231	-7 273	19 231	732 399.68	0.37
Commerzbank Akt Nach Kap			EUR	-	27 430	-	27 430	278 414.50	0.14
Compass Group Plc			GBP	-	18 650	-18 650	-	-	0.00
Conocophillips			USD	1 684	9 683	-9 526	1 841	174 835.94	0.09
Consolidated Edison Inc			USD	5 247	1 386	-1 500	5 133	425 319.16	0.22
Copart Inc			USD	1 776	7 416	-1 701	7 491	626 264.08	0.32
Corning Inc.			USD	-	14 463	-14 463	-	-	0.00
Costco Wholesale Corp			USD	1 533	976	-2 141	368	181 598.39	0.09
Covestro Ag - Usd Equiv.			EUR	6 680	-	-6 680	-	-	0.00
Credit Agricole Sa. Paris			EUR	28 945	24 206	-28 945	24 206	263 167.63	0.13
Croda International Plc			GBP	6 061	5 453	-11 514	-	-	0.00
Crown Castle International Shs			USD	1 111	1 352	-2 463	-	-	0.00
Crown Holdings Inc			USD	-	3 583	-3 583	-	-	0.00
Cummins Inc			USD	1 440	2 664	-2 806	1 298	291 675.23	0.15
Cyberagent Inc			JPY	28 900	-	-28 900	-	-	0.00
Cyber-Ark Software Ltd			USD	-	2 362	-2 362	-	-	0.00
Daito Trust Construct.			JPY	3 600	4 700	-6 400	1 900	175 736.63	0.09
Danone.			EUR	-	6 970	-6 970	-	-	0.00
Darling Ingred – Shs			USD	-	4 412	-	4 412	257 966.53	0.13
Datadog Inc			USD	4 782	545	-5 327	-	-	0.00
Davita Inc – Shs			USD	3 252	2 862	-3 252	2 862	263 561.08	0.13
Deere & Co.			USD	1 405	-	-1 405	-	-	0.00
Dell Technologies Inc			USD	16 163	7 532	-17 716	5 979	296 538.67	0.15
Deutsche Boerse Ag /Nam.			EUR	3 140	504	-3 644	-	-	0.00
Dexcom Inc			USD	6 700	-	-6 700	-	-	0.00
Diageo Plc			GBP	11 234	9 868	-21 102	-	-	0.00
Dollar Tree Inc			USD	3 191	-	-3 191	-	-	0.00
Duke Realty Corp			USD	3 980	2 582	-6 562	-	-	0.00
E.On - Namen Akt.			EUR	-	38 837	-	38 837	453 616.16	0.23
Ebay Inc			USD	6 526	10 611	-6 526	10 611	434 652.24	0.22
Ecolab Inc.			USD	-	2 633	-2 633	-	-	0.00
Edenred			EUR	-	9 303	-9 303	-	-	0.00
Edwards Lifesciences			USD	5 313	5 469	-8 574	2 208	190 908.01	0.10
Eisai Co.Ltd			JPY	-	6 800	-	6 800	419 330.18	0.21
Elanco Animal Health Inc			USD	-	36 741	-6 088	30 653	282 648.19	0.14
Electronic Arts			USD	1 466	8 255	-4 556	5 165	614 024.29	0.31
Element Fleet Management Corp			CAD	-	30 797	-	30 797	430 489.80	0.22
Elisa Corporation A			EUR	12 763	3 102	-12 500	3 365	164 683.10	0.08
Emerson Electric Co.			USD	2 310	7 583	-9 893	-	-	0.00
Enphase Energy Inc Shs			USD	-	1 228	-1 228	-	-	0.00
Equinix Inc /Reit			USD	-	870	-	870	625 140.06	0.32
Equinor Asa			NOK	13 759	-	-13 759	-	-	0.00
Ericsson Tel. B			SEK	37 327	57 974	-40 994	54 307	269 178.36	0.14
Erste Group Bank Ag			EUR	9 644	8 444	-9 644	8 444	270 967.96	0.14
Essential Util Rg			USD	-	10 624	-10 624	-	-	0.00
Essex Property Trust			USD	730	798	-1 528	-	-	0.00
Essilor International			EUR	3 206	-	-3 206	-	-	0.00

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Eversource Energy			USD	-	5 345	-5 345	-	-	0.00
Exact Sciences Corp			USD	-	5 618	-	5 618	483 529.06	0.25
Expeditors Intl Wash.			USD	1 904	3 439	-3 690	1 653	183 526.94	0.09
Experian Plc			GBP	-	13 387	-8 167	5 220	183 582.01	0.09
Extra Space Storage Inc			USD	1 148	2 381	-3 529	-	-	0.00
Facebook Inc -A-			USD	1 056	1 162	-2 218	-	-	0.00
Factset Research System Inc			USD	528	787	-843	472	173 333.46	0.09
Fair Isaac Corp			USD	-	2 073	-1 477	596	442 061.56	0.22
Fast Retailing Co Ltd			JPY	-	1 900	-	1 900	442 444.23	0.23
Fastenal			USD	13 162	4 192	-13 951	3 403	183 999.06	0.09
Fidelity Natl Inform Serv			USD	-	1 007	-1 007	-	-	0.00
Fifth Third Bancorp			USD	-	10 891	-	10 891	261 643.55	0.13
First Solar Inc			USD	-	2 278	-	2 278	396 906.53	0.20
Firstservice – Registered Shs			CAD	-	3 473	-2 198	1 275	180 184.00	0.09
Fiserv Inc.			USD	3 087	3 514	-6 601	-	-	0.00
Fleetcor Technologies Inc			USD	-	449	-449	-	-	0.00
Fortescue Metals Group Ltd			AUD	53 045	37 847	-34 850	56 042	758 396.56	0.39
Fortinet			USD	-	11 737	-2 058	9 679	670 610.09	0.34
Fortune Brands Home & Security			USD	4 369	4 395	-4 369	4 395	289 844.41	0.15
Franklin Resources Inc.			USD	11 508	-	-11 508	-	-	0.00
Fresenius Se & Co Kgaa			EUR	-	3 595	-3 595	-	-	0.00
Gallagher+Co Arthur J.			USD	-	2 114	-2 114	-	-	0.00
Galp Energia Sgps Sa -B- Shrs			EUR	-	30 648	-30 648	-	-	0.00
Garmin			USD	1 954	12 077	-12 261	1 770	169 196.43	0.09
Gartner Inc. *Opa*			USD	1 933	1 496	-2 064	1 365	438 288.86	0.22
Geberit Ag/Namen-Aktien			CHF	379	593	-972	-	-	0.00
General Mills Inc			USD	-	9 703	-4 134	5 569	391 514.48	0.20
Getlink Se			EUR	-	20 309	-20 309	-	-	0.00
Gildan Activewear			CAD	6 492	11 764	-18 256	-	-	0.00
Gilead Sciences Inc.			USD	4 957	8 589	-9 917	3 629	256 358.41	0.13
Givaudan Sa /Reg.			CHF	58	60	-118	-	-	0.00
Glaxosmithkline Plc			GBP	23 667	-	-23 667	-	-	0.00
Godaddy Inc			USD	-	6 497	-6 497	-	-	0.00
Graco Inc			USD	-	8 264	-	8 264	654 075.53	0.33
Great West Lifeco Inc			CAD	-	15 746	-15 746	-	-	0.00
Gsk Plc			GBP	-	48 141	-48 141	-	-	0.00
H.K.Exchanges And Clearing Ltd			HKD	-	13 500	-8 700	4 800	165 731.07	0.08
Haleon Rg			GBP	-	21 832	-21 832	-	-	0.00
Hankyu Hanshin Holdings Inc			JPY	-	15 200	-15 200	-	-	0.00
Hargreaves Lansdown Plc			GBP	-	41 415	-41 415	-	-	0.00
Hasbro Inc.			USD	-	7 323	-7 323	-	-	0.00
Hca Healthcare Inc			USD	-	3 122	-374	2 748	764 402.42	0.39
Henkel Ag & Co. Kgaa			EUR	-	6 650	-6 650	-	-	0.00
Henry Jack & Associates Inc.			USD	3 848	3 461	-6 075	1 234	189 262.35	0.10
Henry Schein Inc.			USD	3 662	4 353	-8 015	-	-	0.00
Hermes International			EUR	174	317	-173	318	632 820.00	0.32
Hess Corp			USD	4 003	4 692	-5 171	3 524	439 127.22	0.22
Hewlett Packard Ent Co			USD	20 211	43 146	-44 812	18 545	285 569.20	0.15
Hilton Inc			USD	3 593	-	-3 593	-	-	0.00
Hologic Inc			USD	10 790	5 958	-10 790	5 958	442 180.81	0.22
Home Depot Inc.			USD	685	2 248	-2 296	637	181 372.76	0.09
Honda Motor Co.Ltd			JPY	-	13 000	-3 500	9 500	261 526.47	0.13
Hongkong Land Hlds Ltd Reg			USD	-	65 600	-	65 600	234 500.46	0.12
Horizon Pharma Shs			USD	-	1 138	-1 138	-	-	0.00
Hormel Foods Corporation			USD	-	9 416	-9 416	-	-	0.00
Hp Inc			USD	7 877	9 667	-8 293	9 251	260 401.66	0.13
Hsbc Holdings Plc			GBP	-	59 882	-59 882	-	-	0.00
Humana Inc.			USD	-	2 405	-958	1 447	593 031.26	0.30
Huntington Bancshares Inc			USD	-	25 953	-	25 953	256 437.53	0.13

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Ia Financial Corporation Inc			CAD	5 883	-	-5 883	-	-	0.00
Iberdrola Sa			EUR	-	37 226	-37 226	-	-	0.00
Ibm			USD	2 171	3 213	-3 250	2 134	261 732.85	0.13
Idex Corp			USD	1 068	3 396	-3 563	901	177 772.01	0.09
Illinois Tool Works			USD	-	3 664	-2 842	822	188 479.85	0.10
Imcd B.V.			EUR	3 441	92	-3 533	-	-	0.00
Incyte Corporation			USD	-	6 918	-6 918	-	-	0.00
Inditex			EUR	8 698	11 614	-14 811	5 501	195 065.46	0.10
Infineon Technologies /Nam.			EUR	-	12 325	-	12 325	465 700.13	0.24
Inpex Corp			JPY	-	33 000	-7 500	25 500	258 415.89	0.13
Insulet Corp			USD	-	1 676	-	1 676	442 949.44	0.23
Insurance Australia Group Ltd			AUD	-	134 170	-134 170	-	-	0.00
Intact Fin			CAD	1 389	1 931	-3 320	-	-	0.00
Intel Corp.			USD	7 122	481	-7 603	-	-	0.00
Intercont Exch			USD	-	4 362	-	4 362	452 112.70	0.23
International Paper Co			USD	6 527	-	-6 527	-	-	0.00
Interpublic Group			USD	16 347	12 597	-16 763	12 181	430 745.17	0.22
Intertek Group Plc			GBP	3 601	13 181	-13 223	3 559	176 883.53	0.09
Intesa Sanpaolo Spa			EUR	-	310 354	-	310 354	744 849.60	0.38
Intuit			USD	-	1 094	-	1 094	459 449.92	0.23
Intuitive Surgical Inc			USD	-	1 509	-	1 509	472 949.09	0.24
Invesco Ltd			USD	16 232	18 521	-16 232	18 521	285 369.40	0.15
Iron Mountain Reit Inc /Reit			USD	-	6 826	-6 826	-	-	0.00
J.Sainsbury Plc			GBP	-	34 574	-34 574	-	-	0.00
Japan Exchange Group Inc			JPY	-	28 000	-	28 000	445 336.02	0.23
Japan Post Holdings Co..Ltd.			JPY	-	60 100	-60 100	-	-	0.00
Jazz Pharmaceuticals Plc			USD	-	2 761	-559	2 202	250 212.59	0.13
Johnson & Johnson			USD	-	5 019	-5 019	-	-	0.00
Juniper Networks Inc.			USD	16 728	13 605	-30 333	-	-	0.00
Kellogg Co			USD	7 488	10 998	-18 486	-	-	0.00
Keycorp			USD	15 722	27 493	-15 722	27 493	232 846.31	0.12
Keyera			CAD	18 377	5 690	-3 860	20 207	427 608.52	0.22
Keysight Technologies Inc			USD	-	1 904	-1 904	-	-	0.00
Kimberly Clark Corp			USD	-	6 316	-1 470	4 846	613 234.43	0.31
Kingfisher Plc			GBP	95 576	-	-95 576	-	-	0.00
Kla Tencor Corporation			USD	1 407	1 028	-1 407	1 028	457 012.43	0.23
Kone Oyj -B-			EUR	4 009	6 289	-10 298	-	-	0.00
Koninklijke Ahold Delhaize N.V.			EUR	-	3 617	-3 617	-	-	0.00
Kroger Co.			USD	-	14 752	-8 597	6 155	265 155.82	0.13
Kuehne +Nagel International			CHF	811	2 400	-2 558	653	177 088.10	0.09
Kyocera Corp			JPY	-	17 300	-17 300	-	-	0.00
L Oreal			EUR	593	504	-1 097	-	-	0.00
La Francaise Des Jeux Saem			EUR	-	21 662	-16 837	4 825	173 893.00	0.09
Laboratory Corp Of Amer.Hld			USD	1 263	1 303	-1 263	1 303	288 224.56	0.15
Lam Research Corp			USD	-	202	-202	-	-	0.00
Lawson Inc			JPY	9 300	-	-9 300	-	-	0.00
Lennox International Inc.			USD	-	3 362	-1 783	1 579	471 919.83	0.24
Liberty Global Plc -A-			USD	12 785	18 435	-13 806	17 414	269 110.94	0.14
Liberty Global Plc -C-			USD	12 249	17 506	-13 208	16 547	269 514.38	0.14
Liberty Media Corp			USD	-	21 943	-11 928	10 015	301 184.37	0.15
Liberty Media Corp			USD	-	22 033	-12 011	10 022	300 660.00	0.15
Lilly (Eli) & Co			USD	662	882	-479	1 065	457 803.57	0.23
Lincoln National Corp.			USD	5 458	-	-5 458	-	-	0.00
Linde Plc			EUR	-	2 974	-2 974	-	-	0.00
Linde Plc			EUR	-	2 821	-992	1 829	639 235.50	0.33
Linde Plc			USD	-	992	-992	-	-	0.00
Lkq			USD	5 858	14 622	-6 458	14 022	748 911.04	0.38
Lloyds Banking Group Plc			GBP	540 460	501 107	-540 460	501 107	254 540.98	0.13
Loews Corp			USD	-	8 355	-8 355	-	-	0.00

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Lowe S Companies Inc.			USD	3 697	1 360	-5 057	-	-	0.00
Lpl Investment Holdings Inc			USD	-	1 495	-1 495	-	-	0.00
Lse Group			GBP	-	4 990	-4 990	-	-	0.00
Lululemon Athletica Inc			USD	2 363	1 152	-1 710	1 805	626 207.61	0.32
Lumen Tech Rg			USD	69 768	5 632	-75 400	-	-	0.00
Lvmh Act.			EUR	318	669	-238	749	646 387.00	0.33
M Bishi Hc Rg Shs			JPY	-	161 600	-161 600	-	-	0.00
Manulife Financial Corp			CAD	16 448	14 673	-16 448	14 673	254 499.27	0.13
Markel Corp.			USD	-	673	-327	346	438 662.03	0.22
Marketaxess Holding Inc			USD	727	1 075	-1 133	669	160 302.46	0.08
Marsh & McLennan Cos Inc			USD	4 560	1 211	-2 033	3 738	644 402.42	0.33
Martin Marietta Materials Inc.			USD	-	1 281	-1 281	-	-	0.00
Marubeni Corp.			JPY	47 400	7 700	-55 100	-	-	0.00
Masco Corp.			USD	9 045	5 906	-9 460	5 491	288 793.38	0.15
Mastercard Inc. Shs-A-			USD	573	2 000	-2 069	504	181 689.46	0.09
Mcdonald S Holdings Co (Japan)			JPY	5 500	21 100	-26 600	-	-	0.00
Medibank Private Ltd			AUD	91 843	557 052	-368 683	280 212	601 797.78	0.31
Medical Properties Trust Inc			USD	-	41 529	-7 271	34 258	290 769.09	0.15
Medtronic Holdings Limited			USD	-	5 042	-5 042	-	-	0.00
Merck			USD	9 137	3 526	-12 663	-	-	0.00
Merck Kgaa			EUR	2 782	-	-2 782	-	-	0.00
Metlife Inc			USD	4 633	11 263	-10 560	5 336	276 484.03	0.14
Metso Rg Registered Shs			EUR	-	41 331	-	41 331	456 500.90	0.23
Mettler Toledo Intl Inc.			USD	153	201	-354	-	-	0.00
Microchip Technology Inc.			USD	-	7 422	-1 320	6 102	501 079.91	0.25
Micron Technology Inc			USD	4 381	-	-4 381	-	-	0.00
Microsoft Corp			USD	758	1 789	-581	1 966	613 658.70	0.31
Mid-America Apartment Commun.			USD	1 162	2 092	-2 003	1 251	174 130.94	0.09
Mitsubishi Corp			JPY	-	9 400	-2 800	6 600	290 054.38	0.15
Mitsubishi Electric Corp			JPY	-	33 900	-	33 900	435 768.37	0.22
Mitsui & Co Ltd			JPY	-	14 000	-	14 000	480 405.34	0.24
Mohawk Industries			USD	2 193	3 049	-2 319	2 923	276 385.59	0.14
Molina Healthcare Inc			USD	-	975	-975	-	-	0.00
Molson Coors Registered Shs B			USD	15 128	-	-15 128	-	-	0.00
Moncler S.P.A.			EUR	4 246	6 156	-7 624	2 778	175 958.52	0.09
Mondelez International Inc Wi			USD	-	12 709	-6 367	6 342	424 001.36	0.22
Monolithic Power Systems Inc			USD	-	2 049	-2 049	-	-	0.00
Moody S Corp			USD	714	2 112	-1 385	1 441	459 270.87	0.23
Motorola Soltn /Ex-Distr			USD	2 328	1 414	-2 076	1 666	447 850.12	0.23
Msci Inc -A-			USD	463	662	-731	394	169 477.78	0.09
Natwest Grp Rg			GBP	-	205 771	-119 833	85 938	241 147.13	0.12
Nestle / Act Nom			CHF	4 421	3 727	-8 148	-	-	0.00
Netapp Inc			USD	-	4 780	-4 780	-	-	0.00
Neurocrine Biosciences Inc			USD	-	2 956	-2 956	-	-	0.00
Ngk Insulators Ltd			JPY	20 800	22 800	-20 800	22 800	247 826.60	0.13
Nike Inc B			USD	1 674	2 812	-2 738	1 748	176 834.79	0.09
Nintendo Co.Ltd			JPY	-	11 000	-6 600	4 400	182 543.12	0.09
Nippon Express H Rg			JPY	-	6 500	-1 600	4 900	251 824.38	0.13
Nippon Tel&Tel			JPY	17 400	1 100	-18 500	-	-	0.00
Nissin Foods Holdings Co Ltd			JPY	-	6 900	-6 900	-	-	0.00
Nitto Denko Corp			JPY	-	8 400	-8 400	-	-	0.00
Nortonlifelock Rg			USD	12 640	15 710	-12 640	15 710	267 113.20	0.14
Novartis Ag Basel/Nam.			CHF	3 514	9 949	-8 697	4 766	439 459.45	0.22
Novavax – Registered Shs			USD	6 521	-	-6 521	-	-	0.00
Novo Nordisk A/S /-B-			DKK	6 279	2 830	-4 877	4 232	624 859.60	0.32
Nutrien Ltd			CAD	-	6 128	-969	5 159	279 486.67	0.14
Nvidia Corp.			USD	-	1 198	-	1 198	464 507.75	0.24
Nxp Semiconductor			USD	-	2 095	-539	1 556	291 917.58	0.15
Omnicom Group Inc			USD	7 123	-	-7 123	-	-	0.00

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Omv Ag			EUR	5 216	-	-5 216	-	-	0.00
On Semiconductor Corp			USD	12 626	6 308	-13 509	5 425	470 299.27	0.24
Oneok Inc (New)			USD	7 473	2 791	-2 245	8 019	453 650.49	0.23
Ono Pharmaceutical Co			JPY	-	13 600	-13 600	-	-	0.00
Open Text Corp			CAD	-	2 832	-2 832	-	-	0.00
Oracle Corp			USD	-	5 529	-1 081	4 448	485 529.17	0.25
Orange			EUR	-	8 157	-8 157	-	-	0.00
Orion Corp (New)- Shs-B-			EUR	-	8 743	-8 743	-	-	0.00
Otis Worldwide Corporation			USD	2 755	8 569	-9 123	2 201	179 570.13	0.09
Owens Corning Inc			USD	3 179	2 490	-3 179	2 490	297 841.43	0.15
Paccar Inc.			USD	-	21 434	-11 152	10 282	788 349.50	0.40
Palo Alto Networks Inc			USD	-	4 146	-1 978	2 168	507 741.23	0.26
Paychex Inc.			USD	1 631	6 391	-6 313	1 709	175 239.07	0.09
Paycom Software Inc			USD	-	1 659	-1 017	642	189 033.99	0.10
Pentair Plc			USD	6 062	-	-6 062	-	-	0.00
Pepsico Inc			USD	1 214	4 132	-4 322	1 024	173 845.35	0.09
Pernod-Ricard			EUR	-	1 853	-1 853	-	-	0.00
Phoenix Group Holdings Plc			GBP	-	123 134	-123 134	-	-	0.00
Pnc Financial Services Gp			USD	-	2 287	-	2 287	264 021.68	0.13
Pool Corp			USD	1 771	1 732	-2 926	577	198 136.83	0.10
Power Corp.Canada			CAD	-	17 803	-17 803	-	-	0.00
Ppg Industries Inc.			USD	-	3 375	-	3 375	458 764.89	0.23
Principal Financial Group Inc			USD	-	4 436	-4 436	-	-	0.00
Procter & Gamble Co.			USD	1 407	4 950	-5 071	1 286	178 861.26	0.09
Progressive Corp			USD	-	2 625	-2 625	-	-	0.00
Prologis Inc			USD	3 985	2 744	-6 729	-	-	0.00
Prudential Financial Inc			USD	-	3 403	-	3 403	275 172.01	0.14
Ptc Inc Shs			USD	-	3 512	-3 512	-	-	0.00
Public Storage			USD	625	2 022	-2 647	-	-	0.00
Qbe Insurance Group			AUD	58 206	-	-58 206	-	-	0.00
Qiagen N.V.			EUR	-	9 980	-9 980	-	-	0.00
Qorvo Inc			USD	-	930	-930	-	-	0.00
Qualcomm Inc.			USD	3 642	3 156	-4 354	2 444	266 667.06	0.14
Quest Diagnostics Inc.			USD	6 001	2 469	-8 470	-	-	0.00
Rational Ag. Landsberg Am Lech			EUR	311	566	-877	-	-	0.00
Rb Global Inc Shs			CAD	-	7 962	-4 500	3 462	190 645.91	0.10
Rea Group Ltd			AUD	-	4 833	-2 763	2 070	180 641.97	0.09
Realty Income Corp			USD	-	7 413	-7 413	-	-	0.00
Reckitt Benckiser Group Plc			GBP	-	4 727	-4 727	-	-	0.00
Recruit Holdings Co.Ltd.			JPY	-	16 100	-10 200	5 900	170 728.00	0.09
Regeneron Pharma. Inc.			USD	-	538	-538	-	-	0.00
Regions Financial Corp			USD	37 579	15 649	-37 579	15 649	255 605.11	0.13
Relx Plc			GBP	7 389	19 999	-21 485	5 903	180 293.55	0.09
Remy Cointreau Sa			EUR	2 745	79	-2 824	-	-	0.00
Renesas Electronics Corp			JPY	-	36 100	-9 500	26 600	455 710.33	0.23
Repsol Sa			EUR	30 294	-	-30 294	-	-	0.00
Republic Services Inc.			USD	-	3 380	-3 380	-	-	0.00
Right Anz Banking 15.08.22			AUD	-	407	-407	-	-	0.00
Ritchie Brothers Auctioneers			CAD	-	7 962	-7 962	-	-	0.00
Robert Half Intl Inc.			USD	5 613	6 776	-5 648	6 741	464 764.45	0.24
Roche Holding Ag /Bearer			CHF	1 377	885	-2 262	-	-	0.00
Roche Holding Ag /Genussschein			CHF	-	2 850	-2 264	586	164 201.53	0.08
Rockwool International A/S B			DKK	-	1 114	-	1 114	263 765.84	0.13
Rollins Inc			USD	5 822	4 841	-10 663	-	-	0.00
Roper Technologies Inc			USD	1 207	787	-1 994	-	-	0.00
Royal Bank Of Scotland Group			GBP	180 114	-	-180 114	-	-	0.00
Sa D Ieteren Nv			EUR	-	2 089	-2 089	-	-	0.00
Sage Grp			GBP	-	42 989	-42 989	-	-	0.00
Saint-Gobain			EUR	-	6 836	-2 041	4 795	267 225.35	0.14

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Salesforce – Registered Shs			USD	-	2 211	-	2 211	428 135.53	0.22
Sampo Plc -A-			EUR	-	8 275	-8 275	-	-	0.00
Sanofi			EUR	-	4 974	-4 974	-	-	0.00
Sap Se			EUR	-	4 389	-4 389	-	-	0.00
Sba Communications Corp/Reit			USD	600	2 623	-2 388	835	177 378.19	0.09
Scentre Group /Reit			AUD	-	157 042	-	157 042	253 911.80	0.13
Seagate Hldgs Rg			USD	-	1 618	-1 618	-	-	0.00
Sealed Air Corp (New)			USD	8 080	-	-8 080	-	-	0.00
Seb Sa			EUR	-	5 298	-5 298	-	-	0.00
Secom Ltd			JPY	-	6 900	-6 900	-	-	0.00
Seiko Epson Corp			JPY	-	6 600	-6 600	-	-	0.00
Semptra Energy			USD	3 156	-	-3 156	-	-	0.00
Sensata Tec			USD	6 308	6 582	-6 308	6 582	271 424.55	0.14
Shell Rg Registered Shs			EUR	-	16 170	-	16 170	446 211.15	0.23
Shimano Inc.			JPY	1 200	2 100	-2 200	1 100	167 140.52	0.08
Shionogi & Co Ltd			JPY	9 700	700	-10 400	-	-	0.00
Siemens Ag /Nam.			EUR	-	2 775	-	2 775	423 298.50	0.22
Sino Land Co Ltd			HKD	216 000	-	-216 000	-	-	0.00
Sirius Xm Holdings Inc			USD	32 860	205 294	-159 209	78 945	327 791.80	0.17
Sitc International Holdings			HKD	54 000	76 000	-130 000	-	-	0.00
Skyworks Solutions Inc			USD	2 854	2 689	-2 854	2 689	272 818.89	0.14
Smiths Group Plc			GBP	-	21 561	-21 561	-	-	0.00
Snam Az			EUR	-	83 288	-83 288	-	-	0.00
Snap-On Inc			USD	2 314	1 744	-4 058	-	-	0.00
Softbank Corp.			JPY	-	44 400	-44 400	-	-	0.00
Solaredge Technologies Inc			USD	-	2 989	-1 371	1 618	399 012.74	0.20
Solvay Sa			EUR	-	4 280	-	4 280	437 844.00	0.22
Sonic Healthcare			AUD	12 163	-	-12 163	-	-	0.00
Spirax-Sarco Engineering Plc			GBP	1 550	1 588	-3 138	-	-	0.00
Standard Chartered Plc			GBP	-	13 474	-13 474	-	-	0.00
Start Today			JPY	10 500	16 200	-17 700	9 000	169 569.38	0.09
State Street Corp			USD	4 246	3 950	-4 246	3 950	264 950.50	0.13
Ste Gen.Paris -A-			EUR	11 504	11 682	-11 504	11 682	278 031.60	0.14
Stora Enso Ab /-R-			EUR	27 023	2 005	-29 028	-	-	0.00
Sumitomo Electric Industries			JPY	-	29 800	-29 800	-	-	0.00
Swiss Life Holding /Nam			CHF	919	-	-919	-	-	0.00
Swisscom /Nam.			CHF	-	673	-373	300	171 443.89	0.09
Synchrony Financial			USD	8 524	8 554	-8 524	8 554	265 950.21	0.14
Synopsys Inc.			USD	2 195	901	-1 628	1 468	585 867.90	0.30
Sysco Corp.			USD	6 071	250	-6 321	-	-	0.00
T Rowe Price Group Inc.			USD	1 639	3 022	-2 962	1 699	174 447.28	0.09
Taisei Corp.			JPY	9 900	-	-9 900	-	-	0.00
Takeda Pharmaceutical Co Ltd			JPY	-	16 900	-16 900	-	-	0.00
Target Corp			USD	1 325	1 235	-2 560	-	-	0.00
Taylor Wimpey Plc			GBP	188 954	208 266	-204 667	192 553	230 553.92	0.12
Te Connectivity /Reg Shs			USD	2 337	6 893	-9 230	-	-	0.00
Telefonica Sa			EUR	63 112	4 391	-67 503	-	-	0.00
Tesco Rg			GBP	-	152 771	-152 771	-	-	0.00
Tesla Mtrs			USD	1 009	4 158	-4 286	881	211 383.47	0.11
Texas Instruments Inc			USD	1 197	7 334	-7 456	1 075	177 379.93	0.09
The Swatch Group Ag			CHF	1 222	967	-1 222	967	258 675.68	0.13
Thomson Reuters Corp			CAD	2 064	1 524	-3 588	-	-	0.00
Tjx Companies Inc			USD	-	11 617	-3 174	8 443	656 170.46	0.33
T-Mobile Us Inc			USD	3 728	3 591	-3 728	3 591	457 185.98	0.23
Tmx Group Ltd			CAD	-	3 929	-3 929	-	-	0.00
Tobu Railway Co.Ltd			JPY	-	19 800	-19 800	-	-	0.00
Tokio Marine Holdings Inc			JPY	9 100	12 900	-22 000	-	-	0.00
Toro Co			USD	-	4 306	-4 306	-	-	0.00
Toromont Industries Ltd			CAD	2 364	4 120	-6 484	-	-	0.00

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Total Sa			EUR	-	8 548	-8 548	-	-	0.00
Toyota Tsusho Corp.			JPY	-	6 100	-	6 100	276 165.53	0.14
Tractor Supply Co			USD	2 569	3 879	-3 325	3 123	632 901.28	0.32
Travelers Companies Inc *Opr*			USD	2 893	4 658	-4 861	2 690	428 180.93	0.22
Trend Micro Inc..Tokyo			JPY	3 800	3 300	-7 100	-	-	0.00
Truist Finl Rg			USD	6 235	8 810	-6 235	8 810	245 081.12	0.12
Ubs Group Ag			CHF	-	19 311	-5 104	14 207	263 380.27	0.13
Ulta Beauty Inc			USD	-	2 486	-925	1 561	673 326.12	0.34
Unilever Plc			EUR	-	8 184	-8 184	-	-	0.00
United Rentals Inc.			USD	-	782	-	782	319 229.46	0.16
Unitedhealth Group Inc			USD	1 039	857	-1 896	-	-	0.00
Univ Mu Gr Br Rg			EUR	-	21 813	-12 489	9 324	189 743.40	0.10
Upm-Kymmene Corp			EUR	-	9 450	-9 450	-	-	0.00
Uss Co Ltd Tokai			JPY	39 800	15 600	-44 000	11 400	171 917.05	0.09
Veeva Systems Inc			USD	-	2 564	-1 598	966	175 075.33	0.09
Venture Corporation Ltd			SGD	-	26 000	-	26 000	259 030.59	0.13
Verbund Ag/-A-			EUR	5 033	204	-5 237	-	-	0.00
Verisign Inc			USD	1 131	3 437	-3 738	830	171 911.18	0.09
Verisk Anlytcs			USD	4 123	809	-4 081	851	176 307.54	0.09
Verizon Communications Inc			USD	6 003	19 457	-17 287	8 173	278 601.16	0.14
Vertex Pharmaceuticals			USD	-	2 908	-932	1 976	637 373.20	0.32
Vf Corp			USD	-	2 082	-2 082	-	-	0.00
Viacombcs Inc Cl-B			USD	10 145	843	-10 988	-	-	0.00
Vici Properties Inc Reit			USD	-	13 523	-13 523	-	-	0.00
Vifor Pharma 2L N			CHF	-	551	-551	-	-	0.00
Visa Inc -A			USD	984	3 339	-1 441	2 882	627 330.30	0.32
Vmware Inc			USD	2 372	3 708	-2 664	3 416	449 903.79	0.23
Vodafone Group Plc			GBP	-	364 060	-69 080	294 980	254 266.17	0.13
Walgreens Boots Alliance Inc			USD	7 210	9 061	-7 210	9 061	236 615.85	0.12
Waste Management Inc			USD	1 300	3 984	-5 284	-	-	0.00
Waters Corporation			USD	1 508	141	-1 649	-	-	0.00
Webster Financial (Conn)			USD	-	7 518	-	7 518	260 132.45	0.13
Wec Energy Group Inc.			USD	-	3 546	-3 546	-	-	0.00
Welltower Inc /Reit			USD	-	1 132	-1 132	-	-	0.00
West Fraser Timber Co			CAD	8 981	-	-8 981	-	-	0.00
West Pharmaceutical Services			USD	1 633	1 856	-2 941	548	192 111.42	0.10
Western Digital Corp.			USD	5 140	-	-5 140	-	-	0.00
Western Union Company			USD	17 253	24 170	-41 423	-	-	0.00
Westrock Co			USD	-	2 091	-2 091	-	-	0.00
Weyerhaeuser Co			USD	-	15 299	-8 764	6 535	200 722.14	0.10
Whirlpool Corp.			USD	1 791	-	-1 791	-	-	0.00
Willis Towers Wats Npv			USD	-	2 004	-2 004	-	-	0.00
Wix.Com Ltd			USD	-	6 154	-	6 154	441 328.10	0.22
Wolters Kluwer Nv			EUR	2 158	6 911	-7 503	1 566	182 125.80	0.09
Woodside Petrole Rg			AUD	-	14 263	-14 263	-	-	0.00
Wp Carey Inc Reit			USD	-	11 811	-5 140	6 671	413 100.60	0.21
Ww Grainger Inc			USD	1 426	674	-1 127	973	703 297.96	0.36
Yakult Honsha			JPY	9 500	-	-9 500	-	-	0.00
Yokogawa Electric Corp			JPY	-	19 000	-19 000	-	-	0.00
Yum Brands Shs			USD	-	6 936	-5 535	1 401	177 918.01	0.09
Zoetis Inc -A-			USD	-	2 906	-2 906	-	-	0.00
Zurich Insurance Group /Nam			CHF	-	936	-936	-	-	0.00
							89 582 809.30	45.56	
Anleihen									
1St Am Fin 4.6% 14-15.11.24	4.600	15.11.24	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	984 277.78	0.50
3M Co 0.95% 15-15.05.23	0.950	15.05.23	EUR	-	1 370 000	-1 370 000	-	-	0.00
Ab Inbev 4% 13-24.09.25 Emtn	4.000	24.09.25	GBP	-	1 200 000	-	1 200 000	1 333 644.98	0.68
Adcb Fin	4.500	06.03.23	USD	1 600 000	-	-1 600 000	-	-	0.00

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Affil Mngrs 3.5% 15-01.08.25	3.500	01.08.25	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	953 735.12	0.49
Alibaba Grp 3.6% 15-28.11.24	3.600	28.11.24	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	976 907.35	0.50
Amadeus It 2.50% 20-20.05.24	2.500	20.05.24	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	985 034.00	0.50
Anz Nz Intl 1.125% 18-20.03.25	1.125	20.03.25	EUR	-	1 440 000	-1 440 000	-	-	0.00
Arcelik	0.000	03.04.23	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Ashtead Cap 4.25% 19-01.11.29	4.250	01.11.29	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	915 563.53	0.47
Auchan 2.875% 20-29.01.26	2.875	29.01.26	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 430 187.00	0.73
Aus 1.5% Notes 21.06.31 1.75%	1.500	21.06.31	AUD	-	32 700 000	-10 000 000	22 700 000	8 068 244.20	4.10
Australia 1.25% 19-21.05.32	1.250	21.05.32	AUD	14 100 000	3 300 000	-17 400 000	-	-	0.00
Australia 3.25% 13-21.04.25	3.250	21.04.25	AUD	-	6 100 000	-6 100 000	-	-	0.00
Avery Denn 1.25% 17-03.03.25	1.250	03.03.25	EUR	-	1 470 000	-	1 470 000	1 390 017.27	0.71
Axtel 6.375% 17-14.11.24	6.375	14.11.24	USD	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Azr Pwr Slr 5.65% 19-24.12.24 Regs	5.650	24.12.24	USD	1 460 000	-	-1 460 000	-	-	0.00
Baidu Inc 4.375% 18-14.05.24	4.375	14.05.24	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	994 425.97	0.51
Banco Bvacs 4.875% 15-21.04.25	4.875	21.04.25	USD	1 440 000	-	-1 440 000	-	-	0.00
Banco Peru 3.25% 19-04.10.26 Regs	3.250	04.10.26	USD	690 000	-	-690 000	-	-	0.00
Bank Mandiri 3.75% 19-11.04.24	3.750	11.04.24	USD	1 490 000	-	-	1 490 000	1 342 666.10	0.68
Bank Rakyat 4.625% 18-20.07.23	4.625	20.07.23	USD	1 600 000	-	-1 600 000	-	-	0.00
Barry Calbt 2.375% 16-24.05.24	2.375	24.05.24	EUR	-	1 380 000	-	1 380 000	1 358 463.72	0.69
Bbva 5% 12-26.08.22	5.000	26.08.22	USD	1 600 000	-	-1 600 000	-	-	0.00
Bco Sab 0.625% 19-07.11.25	0.625	07.11.25	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	945 804.00	0.48
Bdo Unibk 2.95% 17-06.03.23 Regs	2.950	06.03.23	USD	1 600 000	-	-1 600 000	-	-	0.00
Bfcm 1.25% 20-05.12.25	1.250	05.12.25	GBP	-	1 300 000	-	1 300 000	1 330 641.14	0.68
Bg Energy 5.125% 10-01.12.25	5.125	01.12.25	GBP	-	1 200 000	-	1 200 000	1 362 490.51	0.69
Bgeo Group 6% 16-26.07.23	6.000	26.07.23	USD	1 440 000	-	-1 440 000	-	-	0.00
Bk Leumi 3.275% 20-29.01.31	3.275	29.01.31	USD	1 700 000	-	-1 700 000	-	-	0.00
Bk Scotia 3.45% 22-11.04.25	3.450	11.04.25	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	970 963.62	0.49
Bk Tabungan 4.2% 23.01.25	4.200	23.01.25	USD	1 477 000	-	-1 477 000	-	-	0.00
Bos Fund 4% 19-18.09.24 Regs	4.000	18.09.24	USD	1 510 000	-	-1 510 000	-	-	0.00
Caixabank 1.625% 22-13.04.26	1.625	13.04.26	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	945 006.00	0.48
Cbq Finance 5% 18-24.05.23	5.000	24.05.23	USD	1 570 000	-	-1 570 000	-	-	0.00
Cdbl Fundin 3% 17-24.04.23 Regs	3.000	24.04.23	USD	1 700 000	-	-1 700 000	-	-	0.00
China Overs 4.25% 18-26.04.23	4.250	26.04.23	USD	1 620 000	-	-1 620 000	-	-	0.00
Cibc 0.375% 19-03.05.24	0.375	03.05.24	EUR	-	1 430 000	-	1 430 000	1 386 369.27	0.71
Comzkb 1.125% 17-19.09.25	1.125	19.09.25	EUR	-	1 100 000	-	1 100 000	1 016 684.90	0.52
Delta Lloyd 4.375% 14-Perp	4.375	31.12.99	EUR	-	1 360 000	-1 360 000	-	-	0.00
Deutschland 1.80% 22-15.08.53	1.800	15.08.53	EUR	-	5 700 000	-	5 700 000	4 981 800.00	2.53
Dxc Tech 1.75% 18-15.01.26	1.750	15.01.26	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 391 992.50	0.71
Ebay 3.6% 17-05.06.27	3.600	05.06.27	USD	1 300 000	-	-	1 300 000	1 127 075.55	0.57
Eib 4.25% 20-19.06.24	4.250	19.06.24	MXN	-	20 000 000	-	20 000 000	1 007 946.86	0.51
Entel 4.875% 13-30.10.24 /Pool	4.875	30.10.24	USD	1 760 000	-	-	1 760 000	1 064 361.75	0.54
Falabella 3.75% 13-30.04.23	3.750	30.04.23	USD	1 630 000	-	-1 630 000	-	-	0.00
Fiserv 2.25% 19-01.07.25	2.250	01.07.25	GBP	-	1 200 000	-	1 200 000	1 283 628.28	0.65
Flex Ltd 4.875% 20-12.05.30	4.875	12.05.30	USD	1 340 000	-	-1 340 000	-	-	0.00
Glbl Ports 6.5% 16-22.09.23	6.500	22.09.23	USD	1 350 000	-	-1 350 000	-	-	0.00
Goodman Aus 1.375% 17-27.09.25	1.375	27.09.25	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 385 550.00	0.70
Gpi 4.0% 20-15.08.28	4.000	15.08.28	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Haitong Int 3.375% 19-19.07.24	3.375	19.07.24	USD	1 700 000	-	-	1 700 000	1 503 576.27	0.76
Hess Midstr 5.125% 19-15.06.28	5.125	15.06.28	USD	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Hkt Capital 3.625% 15-02.04.25	3.625	02.04.25	USD	-	1 600 000	-	1 600 000	1 412 405.69	0.72
Hsbc Hldg 3.95% 18-18.05.24	3.950	18.05.24	USD	-	1 600 000	-1 600 000	-	-	0.00
Ing Groep 3% 19-18.02.26	3.000	18.02.26	GBP	-	1 300 000	-	1 300 000	1 377 605.38	0.70
Ing Groep 3.95% 17-29.03.27	3.950	29.03.27	USD	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Isp 3.75% 20-Perp Regs	3.750	31.12.99	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Janus Cap 4.875% 15-01.08.25	4.875	01.08.25	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	992 204.27	0.50
Japfa Comfd 5.375% 21-23.03.26	5.375	23.03.26	USD	2 100 000	-	-2 100 000	-	-	0.00
Jnj 0.65% 16-20.05.24	0.650	20.05.24	EUR	-	1 420 000	-	1 420 000	1 381 936.90	0.70
Johnson&Johns 5.5% 07-06.11.24	5.500	06.11.24	GBP	-	1 100 000	-	1 100 000	1 275 261.17	0.65
Jsl Europe 5.20% 21-26.01.31	5.200	26.01.31	USD	1 800 000	-	-1 800 000	-	-	0.00

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Kellogg Co 1% 16-17.05.24	1.000	17.05.24	EUR	-	1 420 000	-	1 420 000	1 385 317.92	0.70
Keysight 4.55% 15-30.10.24	4.550	30.10.24	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	901 358.42	0.46
Kpn 5.625% 09-30.09.24	5.625	30.09.24	EUR	-	1 310 000	-	1 310 000	1 337 274.20	0.68
Lab Corp 3.6% 15-01.02.25	3.600	01.02.25	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Lab Corp 3.6% 17-01.09.27	3.600	01.09.27	USD	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Ldkr B-W 0.375% 19-24.05.24	0.375	24.05.24	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	968 249.00	0.49
Ldkr B-W 1.50% 20-03.02.25	1.500	03.02.25	GBP	-	1 300 000	-	1 300 000	1 391 197.05	0.71
Lennox Int 1.35% 20-01.08.25	1.350	01.08.25	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	919 659.91	0.47
Lenovo Grp 3.421% 20-02.11.30	3.421	02.11.30	USD	1 700 000	-	-	1 700 000	1 314 149.86	0.67
Lg Chem 3.25% 19-15.10.24	3.250	15.10.24	USD	-	1 600 000	-	1 600 000	1 418 816.62	0.72
Lg Chem 3.625% 19-15.04.29	3.625	15.04.29	USD	1 400 000	-	-1 400 000	-	-	0.00
Lkq Italia 3.875% 16-01.04.24	3.875	01.04.24	EUR	-	1 360 000	-	1 360 000	1 356 193.36	0.69
Lundin Ener 2.0% 21-15.07.26	2.000	15.07.26	USD	1 200 000	-	-	1 200 000	987 956.14	0.50
Marb Bond 3.95% 21-29.01.31	3.950	29.01.31	USD	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Mastercard 2.0% 19-03.03.25	2.000	03.03.25	USD	-	1 200 000	-	1 200 000	1 045 909.90	0.53
Moh 4.375% 20-15.06.28	4.375	15.06.28	USD	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Molnycke H 1.75% 15-28.02.24	1.750	28.02.24	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	983 878.00	0.50
Motorola Sol. 7.5% 95-15.05.25	7.500	15.05.25	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	937 786.71	0.48
Natwest 4.269% 19-22.03.25	4.269	22.03.25	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	990 569.07	0.50
Natwest Mar 0.125% 21-12.11.25	0.125	12.11.25	EUR	-	1 100 000	-	1 100 000	996 616.50	0.51
Nbm Us Hold 7% 19-14.05.26 Regs	7.000	14.05.26	USD	1 400 000	-	-1 400 000	-	-	0.00
Nibc Bk Nv 0.875% 19-08.07.25	0.875	08.07.25	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 370 126.36	0.70
P&G 1.125% 15-02.11.23	1.125	02.11.23	EUR	-	1 400 000	-	1 400 000	1 388 118.20	0.71
Regions Fin 2.25% 20-18.05.25	2.250	18.05.25	USD	-	1 400 000	-1 400 000	-	-	0.00
Rizal Co C 4.125% 18-16.03.23	4.125	16.03.23	USD	1 610 000	-	-1 610 000	-	-	0.00
Rural Elec 3.50% 19-12.12.24	3.500	12.12.24	USD	1 800 000	-	-	1 800 000	1 586 564.76	0.81
Santander	4.125	09.11.22	USD	1 600 000	-	-1 600 000	-	-	0.00
Schneid El 0.875% 15-11.03.25	0.875	11.03.25	EUR	-	1 400 000	-	1 400 000	1 339 667.00	0.68
Seb 0.25% 17-20.06.24	0.250	20.06.24	EUR	-	1 440 000	-	1 440 000	1 390 583.33	0.71
Signify N.V 2.0% 20-11.05.24	2.000	11.05.24	EUR	-	1 400 000	-	1 400 000	1 373 414.00	0.70
Sk Brdband 3.875% 18-13.08.23	3.875	13.08.23	USD	1 580 000	-	-	1 580 000	1 444 881.76	0.73
Sk Hynix 3% 19-17.09.24	3.000	17.09.24	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 760 054.39	0.90
Sunny Op 3.75% 18-23.01.23 Regs	3.750	23.01.23	USD	1 600 000	-	-1 600 000	-	-	0.00
Svb Fin Grp 3.5% 15-29.01.25	3.500	29.01.25	USD	-	1 300 000	-1 300 000	-	-	0.00
Synchrony 4.375% 19-19.03.24	4.375	19.03.24	USD	-	1 100 000	-1 100 000	-	-	0.00
Tapestry Inc 4.25% 15-01.04.25	4.250	01.04.25	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	892 689.21	0.45
Tele2 Ab 1.125% 18-15.05.24	1.125	15.05.24	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	974 665.00	0.50
Transport 5.55% 18-01.11.28 Regs	5.550	01.11.28	USD	1 350 000	-	-	1 350 000	1 198 661.06	0.61
Turk Telek 6.875% 19-28.02.25 Regs	6.875	28.02.25	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Turkcell 5.8% 18-11.04.28 Regs	5.800	11.04.28	USD	1 650 000	-	-1 650 000	-	-	0.00
Tyco Elect 3.45% 14-01.08.24	3.450	01.08.24	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	984 520.66	0.50
Verizon Com Frn 18-15.05.25	0.000	15.05.25	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	1 016 913.60	0.52
Vmware Inc 3.9% 17-21.08.27	3.900	21.08.27	USD	1 600 000	-	-	1 600 000	1 390 988.98	0.71
Vmware Inc 4.50% 20-15.05.25	4.500	15.05.25	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	987 762.48	0.50
Weibo 3.375% 20-08.07.30	3.375	08.07.30	USD	1 595 000	-	-1 595 000	-	-	0.00
Weichai Int 3.75% 17-Perp	3.750	31.12.99	USD	1 800 000	-	-1 800 000	-	-	0.00
Weyerhaeuser 6.95% 97-01.10.27	6.950	01.10.27	USD	900 000	-	-900 000	-	-	0.00
Xylem 1.95% 20-30.01.28	1.950	30.01.28	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 206 704.23	0.61
								86 117 718.76	43.80

Anlagefonds

Jss In S Eq Td I10C	31.12.99	USD	25 337	-	-25 337	-	-	-	0.00
Jss In Sseq Sem Shs I Usd Acc Cap	31.12.99	USD	133 124	23 700	-	156 824	9 652 366.27		4.91
							9 652 366.27		4.91

Indexoptionen

Euro Stoxx 50 Pr	15.12.23	EUR	-	-	-140	-140	-137 620.00		-0.07
Euro Stoxx 50 Pr	15.12.23	EUR	-	-	-140	-140	-20 440.00		-0.01
Euro Stoxx 50 Pr	15.12.23	EUR	-	140	-	140	130 760.00		0.07

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Euro Stoxx 50 Pr		16.12.22	EUR	-	130	-130	-	-	0.00
Euro Stoxx 50 Pr		16.12.22	EUR	-	130	-130	-	-	0.00
Euro Stoxx 50 Pr		16.09.22	EUR	-	103	-103	-	-	0.00
Euro Stoxx 50 Pr		16.12.22	EUR	-	130	-130	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.12.23	USD	-	-	-110	-110	-1 508 845.10	-0.77
Spx - S&P 500 Indices		15.12.23	USD	-	110	-	110	731 989.00	0.37
Spx - S&P 500 Indices		15.12.23	USD	-	-	-110	-110	-144 179.65	-0.07
Spx - S&P 500 Indices		16.09.22	USD	-	62	-62	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		16.12.22	USD	-	87	-87	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		16.12.22	USD	-	87	-87	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		16.12.22	USD	-	87	-87	-	-	0.00
								-948 335.75	-0.48
Schatzwechsel									
Deutschland 0% 22-20.09.23 Tb		20.09.23	EUR	-	10 000 000	-10 000 000	-	-	0.00
Deutschland 0% 22-22.11.23 Tb		22.11.23	EUR	-	12 000 000	-12 000 000	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-17.01.24 Tb		17.01.24	EUR	-	6 000 000	-6 000 000	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-20.03.24 Tb		20.03.24	EUR	-	6 000 000	-6 000 000	-	-	0.00
								-	0.00
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								184 404 558.58	93.79
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden									
Anleihen									
Banco Peru 3.375% 18-18.01.23	3.375	18.01.23	USD	1 700 000	-	-1 700 000	-	-	0.00
China O&G 4.70% 21-30.06.26	4.700	30.06.26	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Gartner Inc 3.625% 21-15.06.29	3.625	15.06.29	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Gas Lima 4.375% 13-1.04.23 Reg S	4.375	01.04.23	USD	1 600 000	-	-1 600 000	-	-	0.00
Keycorp 3.878% 22-23.05.25	3.878	23.05.25	USD	-	1 100 000	-1 100 000	-	-	0.00
Movida 5.25% 21-08.02.31 Regs	5.250	08.02.31	USD	2 020 000	-	-2 020 000	-	-	0.00
Natl Bk 3.75% 22-09.06.25	3.750	09.06.25	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	984 432.41	0.50
Promigas/Ga 3.75% 19-16.10.29 Regs	3.750	16.10.29	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 166 534.05	0.60
Td Synnex 1.25% 22-09.08.24	1.250	09.08.24	USD	-	1 700 000	-	1 700 000	1 474 288.59	0.75
Teleflex 4.25% 20-01.06.28 Regs	4.250	01.06.28	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Telekom Malay. 7.875% 95-25 Reg.S	7.875	01.08.25	USD	690 000	-	-	690 000	653 186.32	0.33
Truist Finl 1.125% 20-03.08.27	1.125	03.08.27	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
								4 278 441.37	2.18
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								4 278 441.37	2.18
SUMME WERTPAPIERBESTAND								188 682 999.95	95.97
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								7 040 355.72	3.58
Sonstige Aktiven								891 589.03	0.45
GESAMTNETTOVERMÖGEN								196 614 944.70	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Green Planet

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Aalberts – Bearer Shs			EUR	138 851	15 546	-35 291	119 106	4 589 154.18	1.29
Acea			EUR	194 894	-	-194 894	-	-	0.00
Advanced Drainage Systems			USD	65 926	4 157	-13 280	56 803	5 923 964.56	1.66
Agilent Technologies			USD	58 404	3 770	-10 652	51 522	5 678 753.90	1.59
Aker Carbon Rg			NOK	606 625	-	-	606 625	728 669.28	0.20
American Water Works Co Inc			USD	66 114	11 190	-	77 304	10 114 707.61	2.84
Analog Devices Inc			USD	24 502	10 045	-	34 547	6 168 745.25	1.73
Arcadis N.V.			EUR	170 786	13 118	-4 668	179 236	6 861 154.08	1.93
Aurubis Ag			EUR	49 025	25 102	-13 510	60 617	4 760 859.18	1.34
Autodesk Inc.			USD	29 485	1 727	-7 614	23 598	4 425 652.41	1.24
Ballard Power Systems Inc			CAD	72 799	-	-72 799	-	-	0.00
Cadeler Rg			NOK	392 330	113 980	-	506 310	1 944 938.58	0.55
Carbios Sa			EUR	13 008	1 027	-	14 035	491 225.00	0.14
Cimc Enric Hldg			HKD	5 105 759	399 963	-2 106 276	3 399 446	2 783 252.01	0.78
Clean Harbors Inc			USD	75 596	15 006	-12 417	78 185	11 783 647.62	3.31
Coca-Cola Europ Prntr			USD	144 317	23 545	-20 454	147 408	8 705 313.88	2.44
Danaher Corp			USD	53 482	3 609	-15 228	41 863	9 209 092.58	2.58
Daqo New Energy/Sadr			USD	30 652	13 740	-44 392	-	-	0.00
Darling Ingred – Shs			USD	-	64 514	-	64 514	3 772 088.05	1.06
Duerr Ag			EUR	104 881	5 012	-49 894	59 999	1 778 370.36	0.50
Ebara Corp.			JPY	111 072	21 415	-11 109	121 378	5 282 703.50	1.48
Ecolab Inc.			USD	35 023	5 608	-	40 631	6 952 705.22	1.95
Elis Sa			EUR	293 362	-	-293 362	-	-	0.00
Entegris Inc			USD	85 073	4 906	-41 963	48 016	4 877 298.92	1.37
Evoqua Water Technologies Corp			USD	138 467	15 617	-154 084	-	-	0.00
Flsmidth & Co. A/S B			DKK	131 869	2 901	-24 386	110 384	4 895 130.20	1.37
Georg Fischer N			CHF	91 916	4 829	-30 723	66 022	4 542 102.73	1.27
Hydro One Ltd			CAD	-	284 796	-	284 796	7 466 774.94	2.09
Iindex Corp			USD	16 543	2 596	-2 046	17 093	3 372 538.20	0.95
Infineon Technologies /Nam.			EUR	188 396	29 130	-	217 526	8 219 219.91	2.31
Kubota Corp			JPY	176 703	2 800	-179 503	-	-	0.00
Kurita Water Ind.Ltd			JPY	208 884	20 800	-31 126	198 558	6 917 964.11	1.94
Lundin Mining Corp			CAD	228 944	267 944	-	496 888	3 572 639.16	1.00
Masco Corp.			USD	101 045	6 867	-27 078	80 834	4 251 379.40	1.19
Microsoft Corp			USD	44 135	4 139	-7 239	41 035	12 808 486.62	3.59
National Grid Plc			GBP	-	675 693	-	675 693	8 192 791.10	2.30
On Semiconductor Corp			USD	169 718	11 071	-39 135	141 654	12 280 142.36	3.45
Outotec Oyj			EUR	951 980	98 038	-	1 050 018	11 597 448.81	3.25
Pennon Grp Rg			GBP	681 920	34 246	-479 398	236 768	1 961 701.77	0.55
Ptc Inc Shs			USD	70 991	6 560	-	77 551	10 115 038.77	2.84
Republic Services Inc.			USD	100 453	14 407	-	114 860	16 125 670.21	4.52
Rohm Co.Ltd			JPY	-	48 981	-	48 981	4 199 587.16	1.18
Roper Technologies Inc			USD	17 878	7 022	-	24 900	10 973 345.55	3.08
Rotork Plc			GBP	1 147 353	78 584	-151 824	1 074 113	3 815 094.60	1.07
Samsung Sdi / Sgdr 144A			EUR	38 972	-	-	38 972	4 540 238.00	1.27
Siemens Ag /Nam.			EUR	70 836	5 304	-3 671	72 469	11 054 421.26	3.10
Sika Ltd			CHF	23 219	1 419	-5 149	19 489	5 105 550.11	1.43
Solaredge Technologies Inc			USD	10 739	18 052	-	28 791	7 100 108.66	1.99
Stantec Inc			CAD	157 292	12 418	-	169 710	10 167 323.04	2.85
Stmicroelectronics Nv			EUR	118 663	33 641	-18 489	133 815	6 097 280.48	1.71
Sulzer Ag/ Namensaktien			CHF	58 657	4 233	-5 020	57 870	4 559 341.07	1.28
Tetra Tech Inc.			USD	45 095	5 681	-4 329	46 447	6 970 881.56	1.96
Thermo Fisher Scientific Inc			USD	20 855	1 528	-1 505	20 878	9 984 506.42	2.80
Trimble Navigation Ltd			USD	82 241	6 494	-15 255	73 480	3 565 564.80	1.00

JSS Sustainable Equity - Green Planet (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Valeo Sa			EUR	113 065	20 994	-	134 059	2 631 578.17	0.74
Valmont Ind.Inc			USD	27 050	2 135	-3 530	25 655	6 844 076.76	1.92
Veolia Environnement			EUR	425 575	127 530	-136 112	416 993	12 071 947.35	3.39
Vestas Wind Br /Rg			DKK	126 086	112 803	-38 131	200 758	4 892 544.88	1.37
Xylem Inc			USD	12 298	77 230	-	89 528	9 241 652.94	2.59
							346 966 367.27	97.33	
Optionen auf Wertpapiere									
Right Carbios 07.07.23 /Sous		31.12.99	EUR	-	14 035	-	14 035	53 333.00	0.01
							53 333.00	0.01	
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind							347 019 700.27	97.34	
SUMME WERTPAPIERBESTAND							347 019 700.27	97.34	
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen							6 766 128.12	1.90	
Sonstige Aktiven							2 699 265.90	0.76	
GESAMTNETTOVERMÖGEN							356 485 094.29	100.00	

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Bond - USD High Yield

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

Altice Usa Inc			USD	16 060	-	-16 060	-	-	0.00
American Axle & Manufact.Hldgs			USD	18 688	560	-950	18 298	151 324.46	0.08
Ardagh Mp Rg			USD	42 650	6 885	-2 445	47 090	177 058.40	0.09
Bausch Health Rg Registered Shs			USD	13 510	-	-13 510	-	-	0.00
Boyd Gaming			USD	3 305	490	-465	3 330	231 002.10	0.12
Brinks Co.			USD	4 485	175	-625	4 035	273 694.05	0.15
Caesars Entertainment Inc			USD	-	6 425	-	6 425	327 482.25	0.17
Compass Minerals International			USD	3 065	-	-3 065	-	-	0.00
Cumulus Media Inc Npv			USD	34 037	3 545	-6 805	30 777	126 185.70	0.07
Dell Technologies Inc			USD	4 770	570	-150	5 190	280 830.90	0.15
Devon Energy Corp.(New)			USD	3 105	-	-25	3 080	148 887.20	0.08
Energizer Holdings Inc			USD	8 225	275	-360	8 140	273 341.20	0.14
Enviva Inc			USD	6 380	1 220	-1 080	6 520	70 742.00	0.04
Gms Inc			USD	5 990	150	-1 705	4 435	306 902.00	0.16
Graphic Packaging Holding Co			USD	17 831	235	-3 375	14 691	353 024.73	0.19
Gray Television Inc			USD	6 110	-	-6 110	-	-	0.00
Iheartmedia Registered Shs -A-			USD	28 910	11 990	-1 785	39 115	142 378.60	0.08
Koppers Holdings Inc			USD	10 805	-	-560	10 245	349 354.50	0.19
Lear Corp			USD	770	315	-40	1 045	150 009.75	0.08
Lumentum Holdings Inc			USD	3 710	1 240	-290	4 660	264 361.80	0.14
Nrg Energy Inc			USD	8 035	405	-1 020	7 420	277 433.80	0.15
O-I Glass Rg			USD	21 980	-	-2 970	19 010	405 483.30	0.22
Pioneer Natural Resources Co			USD	853	50	-30	873	180 868.14	0.10
Red Rock Resorts Inc			USD	7 480	175	-2 910	4 745	221 971.10	0.12
Science Applications Intl Corp			USD	3 555	60	-975	2 640	296 947.20	0.16
Stagwell Rg-A			USD	79 062	16 465	-22 770	72 757	524 577.97	0.28
Suburban Propane Partners Units			USD	23 519	395	-5 210	18 704	276 819.20	0.15
Teck Resources / -B-			USD	6 725	-	-6 725	-	-	0.00
Townsquare Media Inc			USD	23 555	2 670	-8 155	18 070	215 213.70	0.11
Urban One Inc			USD	-	15 985	-15 985	-	-	0.00
Us Foods Holding Corp			USD	6 125	425	-95	6 455	284 020.00	0.15
Vistra Energy Corp			USD	13 675	935	-2 885	11 725	307 781.25	0.16
Westrock Co			USD	6 800	145	-3 100	3 845	111 774.15	0.06
							6 729 469.45	3.59	

Anleihen

Ally Fin 5.75% 15-20.11.25	5.750	20.11.25	USD	-	125 000	-	125 000	120 436.98	0.06
Amerigas	5.500	20.05.25	USD	250 000	100 000	-	350 000	338 237.87	0.18
Amerigas Fi	5.875	20.08.26	USD	700 000	75 000	-	775 000	729 529.82	0.39
Ard Fin 6.5% 19-30.06.27/Pik 144A	6.500	30.06.27	USD	1 679 186	-	-525 000	1 154 186	937 312.90	0.50
Ball Corp 6.0% 23-15.06.29	6.000	15.06.29	USD	-	125 000	-	125 000	124 218.75	0.07
Ball Corp 6.875% 22-15.03.28	6.875	15.03.28	USD	-	175 000	-	175 000	178 647.00	0.10
Bausch 7.25% 19-30.05.29 144A	7.250	30.05.29	USD	650 000	-	-	650 000	277 023.50	0.15
Centene Esc 2.625% 21-01.08.31	2.625	01.08.31	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Centene Esc 3.0% 20-15.10.30	3.000	15.10.30	USD	125 000	-	-125 000	-	-	0.00
Chen Eng 3.25% 21-31.01.32	3.250	31.01.32	USD	-	200 000	-100 000	100 000	82 402.45	0.04
Csc Hldg 7.5% -01.04.28	7.500	01.04.28	USD	375 000	-	-75 000	300 000	171 453.87	0.09
Csc Holding	5.250	01.06.24	USD	525 000	-	-525 000	-	-	0.00
Dolya Holdc 5.0% 20-15.07.28 144A	5.000	15.07.28	USD	500 000	-	-175 000	325 000	284 686.55	0.15
Eqc Corp 3.9% 17-01.10.27	3.900	01.10.27	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Eqc Mdstm 5.5% 18-15.07.28	5.500	15.07.28	USD	625 000	-	-150 000	475 000	449 059.03	0.24
Eqc Mdstm 6.5% 18-15.07.48	6.500	15.07.48	USD	325 000	-	-75 000	250 000	226 483.75	0.12
Ford Mc 3.375% 20-13.11.25	3.375	13.11.25	USD	675 000	-	-	675 000	627 953.72	0.34
Ford Mc 4.0% 20-13.11.30	4.000	13.11.30	USD	850 000	-	-	850 000	727 076.91	0.39

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Ford Mc 4.063% 19-01.11.24	4.063	01.11.24	USD	400 000	-	-	400 000	387 422.04	0.21
Ford Mc 4.125% 20-17.08.27	4.125	17.08.27	USD	350 000	-	-	350 000	319 703.76	0.17
Ford Mc 4.271% 20-09.01.27	4.271	09.01.27	USD	475 000	-	-	475 000	439 482.78	0.23
Ford Mc 4.389% 16-08.01.26	4.389	08.01.26	USD	325 000	-	-	325 000	307 892.02	0.16
Ford Mc 5.113% 19-03.05.29	5.113	03.05.29	USD	500 000	-	-	500 000	464 217.65	0.25
Ford Mc 5.125% 20-16.06.25	5.125	16.06.25	USD	850 000	950 000	-	1 800 000	1 751 427.90	0.93
Freeport Mc 5.25% 19-01.09.29	5.250	01.09.29	USD	225 000	-	-225 000	-	-	0.00
Graphic Pac 4.75% 19-15.07.27	4.750	15.07.27	USD	175 000	-	-	175 000	166 630.52	0.09
Graphic Packagn 3.5% 20-01.03.29	3.500	01.03.29	USD	75 000	-	-	75 000	65 678.45	0.04
Grifols 4.75% 21-15.10.28 144A	4.750	15.10.28	USD	200 000	725 000	-	925 000	803 769.50	0.43
Hca	5.875	15.02.26	USD	200 000	-	-	200 000	200 136.04	0.11
Hca	5.375	01.02.25	USD	475 000	-	-250 000	225 000	223 091.23	0.12
Hca 3.50% 20-01.09.30	3.500	01.09.30	USD	450 000	-	-450 000	-	-	0.00
Iheartcomm 6.375% 19-01.05.26	6.375	01.05.26	USD	50 000	-	-	50 000	42 006.25	0.02
Iheartcomm 8.375% 19-01.05.27	8.375	01.05.27	USD	1 739 891	-	-450 000	1 289 891	861 331.42	0.46
Iho Verwalt 6% 19-15.05.27 /Pik	6.000	15.05.27	USD	475 000	125 000	-	600 000	564 931.54	0.30
Mgm Resorts	6.000	15.03.23	USD	475 000	-	-475 000	-	-	0.00
Navient 5.50% 21-15.03.29	5.500	15.03.29	USD	725 000	-	-	725 000	618 892.63	0.33
Navient 6.75% 17-25.06.25	6.750	25.06.25	USD	175 000	-	-	175 000	172 217.50	0.09
Navient 6.75% 18-15.06.26	6.750	15.06.26	USD	275 000	225 000	-	500 000	484 200.00	0.26
Nrg Energy 5.75% 18-15.01.28	5.750	15.01.28	USD	50 000	-	-50 000	-	-	0.00
Occidental 5.875% 20-01.09.25	5.875	01.09.25	USD	300 000	-	-	300 000	298 229.01	0.16
Occidental 6.125% 20-01.01.31	6.125	01.01.31	USD	325 000	-	-175 000	150 000	152 462.25	0.08
Occidental 6.625% 20-01.09.30	6.625	01.09.30	USD	725 000	-	-400 000	325 000	338 000.00	0.18
Oxy 8.0% 20-15.07.25	8.000	15.07.25	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Oxy 8.875% 20-15.07.30	8.875	15.07.30	USD	275 000	-	-275 000	-	-	0.00
Range Resou	4.875	15.05.25	USD	125 000	-	-	125 000	122 619.62	0.07
Schaeff	0.000	15.09.26	USD	650 000	-	-	650 000	600 268.50	0.32
Seagate Hdd 9.625% 22-01.12.32	9.625	01.12.32	USD	-	766 625	-100 000	666 625	736 047.99	0.39
Sm Energy	5.625	01.06.25	USD	275 000	-	-	275 000	269 046.25	0.14
Sm Energy	6.750	15.09.26	USD	400 000	-	-	400 000	390 243.63	0.21
Sm Energy 6.50% 21-15.07.28	6.500	15.07.28	USD	75 000	-	-75 000	-	-	0.00
Sprint Corp	7.125	15.06.24	USD	475 000	-	-	475 000	479 668.06	0.26
Sthwest En 4.75% 21-01.02.32	4.750	01.02.32	USD	200 000	-	-	200 000	176 554.56	0.09
Sthwest En 5.375% 21-15.03.30	5.375	15.03.30	USD	125 000	-	-	125 000	116 744.64	0.06
Tenet Hlthc	6.750	15.06.23	USD	550 000	-	-550 000	-	-	0.00
Tenet Hlthc 4.25% 21-01.06.29	4.250	01.06.29	USD	425 000	-	-425 000	-	-	0.00
Tenet Hlthc 4.25% 23-01.06.29	4.250	01.06.29	USD	-	425 000	-	425 000	384 363.63	0.21
The Kraft 4.375% 16-01.06.46	4.375	01.06.46	USD	475 000	-	-475 000	-	-	0.00
T-Mobile Us 2.25% 15.02.26 144A	2.250	15.02.26	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
T-Mobile Us 2.25% 21-15.02.26	2.250	15.02.26	USD	250 000	400 000	-650 000	-	-	0.00
T-Mobile Us 2.625% 21-15.02.29	2.625	15.02.29	USD	350 000	-	-350 000	-	-	0.00
T-Mobile Us 2.875% 21-15.02.31	2.875	15.02.31	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
T-Mobile Us 3.375% 21-15.04.29	3.375	15.04.29	USD	-	650 000	-650 000	-	-	0.00
T-Mobile Us 3.375% 21-15.04.29	3.375	15.04.29	USD	650 000	-	-650 000	-	-	0.00
Transdi 6.375% 17-15.06.26	6.375	15.06.26	USD	425 000	-	-25 000	400 000	395 277.84	0.21
Transdigm 5.50% 20-15.11.27	5.500	15.11.27	USD	650 000	-	-	650 000	613 834.33	0.33
Transdigm 7.50% 19-15.03.27	7.500	15.03.27	USD	550 000	-	-	550 000	551 437.15	0.29
Transdigm U 6.875% 18-15.05.26	6.875	15.05.26	USD	325 000	-	-	325 000	322 390.77	0.17
Trivium Pack 5.5% 19-15.08.26	5.500	15.08.26	USD	200 000	-	-	200 000	192 290.18	0.10
Usacmpr Ptr 6.875% 18-01.04.26	6.875	01.04.26	USD	975 000	-	-175 000	800 000	784 257.76	0.42
Usagm Holdc 9.75% 19-15.07.27	9.750	15.07.27	USD	1 850 000	-	-400 000	1 450 000	1 283 779.11	0.68
Utd Rent Na 3.75% 21-15.01.32	3.750	15.01.32	USD	175 000	-	-	175 000	148 435.54	0.08
Utd Rent Na 3.875% 20-15.02.31	3.875	15.02.31	USD	300 000	-	-	300 000	259 985.00	0.14
Utd Rent Na 4.0% 20-15.07.30	4.000	15.07.30	USD	250 000	-	-	250 000	221 666.43	0.12
Utd Rentals 5.5% 16-15.05.27	5.500	15.05.27	USD	111 000	-	-111 000	-	-	0.00
Veritas Us 7.50% 20-01.09.25	7.500	01.09.25	USD	775 000	-	-275 000	500 000	406 513.41	0.22
Western Gas 4.5% 18-01.03.28	4.500	01.03.28	USD	150 000	-	-	150 000	141 669.60	0.08
Western Gas 4.65% 16-01.07.26	4.650	01.07.26	USD	50 000	-	-	50 000	48 152.42	0.03

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Western Gas 4.75% 18-15.08.28	4.750	15.08.28	USD	125 000	-	-	125 000	118 760.28	0.06
Western Gas 5.3% 18-01.03.48	5.300	01.03.48	USD	725 000	-	-300 000	425 000	354 872.92	0.19
Western Gas 5.45% 14-01.04.44	5.450	01.04.44	USD	225 000	-	-225 000	-	-	0.00
Western Gas 5.5% 18-15.08.48	5.500	15.08.48	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Yum Brands 3.625% 20-15.03.31	3.625	15.03.31	USD	75 000	-	-	75 000	64 856.38	0.03
Yum Brands 4.625% 21-31.01.32	4.625	31.01.32	USD	175 000	-	-	175 000	158 307.68	0.08
Ziggo	6.000	15.01.27	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	919 030.40	0.49
Ziggo Bv 4.875% 19-15.01.30	4.875	15.01.30	USD	200 000	-	-	200 000	166 181.88	0.09
								24 363 501.55	13.00

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind **31 092 971.00** **16.59**

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

1011778 Bc 3.50% 20-15.02.29 144A	3.500	15.02.29	USD	225 000	-	-225 000	-	-	0.00
1011778 Bc 3.875% 19-15.01.28 144A	3.875	15.01.28	USD	375 000	-	-375 000	-	-	0.00
1011778 Bc 4.0% 20-15.10.30	4.000	15.10.30	USD	2 425 000	-	-	2 425 000	2 078 270.83	1.11
Academy Ltd 6.0% 20-15.11.27 144A	6.000	15.11.27	USD	275 000	150 000	-	425 000	408 476.00	0.22
Acadia Hlth 5.0% 20-15.04.29	5.000	15.04.29	USD	75 000	-	-75 000	-	-	0.00
Acadia Hlth 5.50% 20-01.07.28	5.500	01.07.28	USD	50 000	-	-50 000	-	-	0.00
Adapthealth 4.625% 21-01.08.29	4.625	01.08.29	USD	600 000	-	-100 000	500 000	399 542.50	0.21
Adapthealth 5.125% 21-01.03.30	5.125	01.03.30	USD	350 000	-	-100 000	250 000	202 742.50	0.11
Adient Glob	4.875	15.08.26	USD	1 050 000	-	-75 000	975 000	927 531.83	0.49
Adient Glob 7% 23-15.04.28 144A	7.000	15.04.28	USD	-	100 000	-	100 000	101 187.50	0.05
Affinity 6.875% 15.12.28 144A	6.875	15.12.27	USD	675 000	-	-	675 000	594 605.57	0.32
Albertsons 3.50% 20-15.03.29 144A	3.500	15.03.29	USD	550 000	-	-325 000	225 000	195 001.47	0.10
Albertsons 5.875% 15.02.28 144A	5.875	15.02.28	USD	250 000	-	-	250 000	243 200.00	0.13
Albertsons 6.5% 23-15.02.28 144A	6.500	15.02.28	USD	-	400 000	-	400 000	401 118.00	0.21
Albertsons 7.5% 19-15.03.26 144A	7.500	15.03.26	USD	175 000	-	-	175 000	178 123.75	0.09
Albertsons C 3.25% 15.03.26 144A	3.250	15.03.26	USD	175 000	-	-	175 000	161 685.97	0.09
Allied Univ 6.0% 21-01.06.29 144A	6.000	01.06.29	USD	825 000	-	-	825 000	609 834.19	0.33
Amer Bid 4.0% 19-15.01.28 144A	4.000	15.01.28	USD	250 000	175 000	-	425 000	387 764.65	0.21
American Ai 5.50% 20-04.26 144A	5.500	20-04.26	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
American Ai 5.75% 20-04.29 P 144A	5.750	20-04.29	USD	475 000	-	-475 000	-	-	0.00
Ams 7.0% 20-31.07.25 144A	7.000	31.07.25	USD	300 000	-	-	300 000	265 175.86	0.14
Amwins Grou 4.875% 30.06.29 144A	4.875	30.06.29	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	994 376.24	0.53
Antero 5.75% 19-01.03.27 144A	5.750	01.03.27	USD	1 125 000	-	-	1 125 000	1 084 829.63	0.58
Antero 5.75% 19-15.01.28	5.750	15.01.28	USD	750 000	-	-125 000	625 000	596 478.44	0.32
Antero 7.625% 21-01.02.29 144A	7.625	01.02.29	USD	188 000	-	-78 000	110 000	111 708.08	0.06
Antero 7.875% 20-15.05.26 144A	7.875	15.05.26	USD	225 000	-	-	225 000	228 239.10	0.12
Antero Mid 5.375% 21-15.06.29	5.375	15.06.29	USD	500 000	-	-400 000	100 000	93 021.99	0.05
Antero Res 5.375% 21-01.03.30	5.375	01.03.30	USD	175 000	-	-	175 000	160 470.15	0.09
Antero Res 8.375% 21-15.07.26	8.375	15.07.26	USD	81 000	-	-81 000	-	-	0.00
Aramark Ser 6.375% 20-01.05.25 144A	6.375	01.05.25	USD	550 000	-	-	550 000	549 943.96	0.29
Archrock 6.25% 19-01.04.28	6.250	01.04.28	USD	725 000	-	-	725 000	678 650.75	0.36
Archrock P 6.875% 19-01.04.27	6.875	01.04.27	USD	1 000 000	-	-250 000	750 000	720 930.00	0.38
Ardagh Meta 4.0% 21-01.09.29	4.000	01.09.29	USD	625 000	-	-375 000	250 000	198 271.73	0.11
Ardagh Pck 5.25% 19-15.08.27 144A	5.250	15.08.27	USD	450 000	175 000	-	625 000	529 789.13	0.28
Ardagh Pck 5.25% 20-15.08.27 144A	5.250	15.08.27	USD	800 000	400 000	-300 000	900 000	762 896.34	0.41
Ardent H S 5.75% 21-15.07.29	5.750	15.07.29	USD	325 000	-	-	325 000	280 546.50	0.15
Ardonagh Mi 11.50% 20-15.01.27 144A	11.500	15.01.27	USD	678 203	243 235	-	921 438	852 330.15	0.45
Asbury Auto 4.625% 21-15.11.29	4.625	15.11.29	USD	150 000	100 000	-	250 000	222 192.40	0.12
Asbury Auto 5.0% 21-15.02.32	5.000	15.02.32	USD	300 000	-	-	300 000	261 504.96	0.14
Ascent Reso 5.875% 21-30.06.29	5.875	30.06.29	USD	300 000	-	-100 000	200 000	178 752.30	0.10
Ascent Reso 7% 18-01.11.26 144A	7.000	01.11.26	USD	575 000	-	-275 000	300 000	290 654.82	0.15
Ascent Reso 8.25% 20-31.12.28	8.250	31.12.28	USD	250 000	-	-	250 000	246 067.40	0.13
Assuredpart 5.625% 20-15.01.29	5.625	15.01.29	USD	525 000	-	-	525 000	454 924.79	0.24
Assuredpart 7% 17-15.08.25 144A	7.000	15.08.25	USD	200 000	-	-	200 000	197 753.07	0.11

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Audacy Capital 6.75% 31.03.29	6.750	31.03.29	USD	450 000	-	-	450 000	12 478.50	0.01
Avantor 4.625% 20-15.07.28 144A	4.625	15.07.28	USD	650 000	-	-	650 000	603 252.78	0.32
Avantor Fdg 3.875% 21-01.11.29	3.875	01.11.29	USD	600 000	-	-100 000	500 000	438 166.15	0.23
Axalta 4.75% 20-15.06.27 144A	4.750	15.06.27	USD	150 000	-	-	150 000	141 538.91	0.08
Axalta Coat 3.375% 20-15.02.29	3.375	15.02.29	USD	150 000	-	-	150 000	127 825.50	0.07
Ball Corp 3.125% 21-15.09.31	3.125	15.09.31	USD	275 000	-	-	275 000	226 552.73	0.12
Bausch 4.875% 21-01.06.28	4.875	01.06.28	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Bausch 5.0% 19-30.01.28	5.000	30.01.28	USD	200 000	-	-	200 000	86 009.00	0.05
Bausch 5.0% 20-15.02.29	5.000	15.02.29	USD	500 000	-	-	500 000	210 752.50	0.11
Bausch 5.25% 19-30.01.30	5.250	30.01.30	USD	675 000	-	-325 000	350 000	145 708.50	0.08
Bausch 5.25% 20-15.02.31 144A	5.250	15.02.31	USD	350 000	-	-	350 000	146 629.00	0.08
Bausch 6.125% 22-01.02.27	6.125	01.02.27	USD	75 000	-	-	75 000	48 101.25	0.03
Bausch 6.25% 20-15.02.29 144A	6.250	15.02.29	USD	250 000	-	-	250 000	107 822.50	0.06
Bausch HI 5.75% 19-15.08.27	5.750	15.08.27	USD	175 000	-	-	175 000	107 422.00	0.06
Bcpe 7.625% 21-01.05.27 144A	7.625	01.05.27	USD	1 225 000	50 000	-	1 275 000	1 187 138.79	0.63
Bellring Br 7.0% 22-15.03.30	7.000	15.03.30	USD	500 000	-	-	500 000	503 685.00	0.27
Berry Glb 5.625% 19-15.07.27 144A	5.625	15.07.27	USD	575 000	-	-	575 000	563 298.75	0.30
Berry Petr 7% 18-15.02.26	7.000	15.02.26	USD	250 000	-	-	250 000	231 547.50	0.12
Booz Allen 3.875% 20-01.09.28	3.875	01.09.28	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Booz Allen 4.0% 21-01.07.29	4.000	01.07.29	USD	75 000	-	-75 000	-	-	0.00
Boxer 9.125% 20-01.03.26 144A	9.125	01.03.26	USD	250 000	325 000	-	575 000	573 076.63	0.31
Boyd Gam 4.75% 19-01.12.27 144A	4.750	01.12.27	USD	400 000	-	-150 000	250 000	237 105.50	0.13
Boyd Gam 4.75% 21-15.06.31	4.750	15.06.31	USD	150 000	-	-	150 000	134 164.20	0.07
Broadstreet 5.875% 21-15.04.29	5.875	15.04.29	USD	1 575 000	175 000	-	1 750 000	1 519 918.93	0.81
Bway 5.5% 17-15.04.24 144A	5.500	15.04.24	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Bway 7.25% 17-15.04.25 144A	7.250	15.04.25	USD	750 000	-	-750 000	-	-	0.00
Bway 7.875% 23-15.08.26	7.875	15.08.26	USD	-	525 000	-100 000	425 000	422 141.46	0.23
Caesars 4.625% 21-15.10.29 144A	4.625	15.10.29	USD	225 000	-	-	225 000	196 660.80	0.10
Caesars25 5.75% 20-01.07.25 144A	5.750	01.07.25	USD	300 000	-	-	300 000	303 810.60	0.16
Callon Petr 6.375% 18-01.07.26	6.375	01.07.26	USD	100 000	-	-	100 000	97 563.80	0.05
Callon Petroleum Co 7.5% 144A	7.500	15.06.30	USD	175 000	-	-	175 000	165 350.19	0.09
Calpine 4.50% 19-15.02.28	4.500	15.02.28	USD	150 000	-	-	150 000	135 945.50	0.07
Calpine 4.625% 20-01.02.29 144A	4.625	01.02.29	USD	225 000	-	-	225 000	190 084.34	0.10
Calpine 5.0% 20-01.02.31	5.000	01.02.31	USD	225 000	-	-	225 000	186 385.82	0.10
Calpine 5.125% 19-15.03.28 144A	5.125	15.03.28	USD	275 000	-	-	275 000	245 777.90	0.13
Calpine 5.25% 16-01.06.26 144A	5.250	01.06.26	USD	125 000	-	-	125 000	120 840.79	0.06
Camelot Ret 8.75% 22-01.08.28	8.750	01.08.28	USD	-	350 000	-	350 000	331 211.77	0.18
Capstone 8.0% 23-15.06.30	8.000	15.06.30	USD	-	475 000	-	475 000	469 528.00	0.25
Carrizo 8.25% 17-15.07.25	8.250	15.07.25	USD	100 000	-	-	100 000	99 442.00	0.05
Cars.Com 6.375% 20-01.11.28	6.375	01.11.28	USD	600 000	-	-	600 000	553 361.89	0.30
Catalent Phar 3.50% 01.04.30	3.500	01.04.30	USD	225 000	-	-225 000	-	-	0.00
Cbs Out Am 4.625% 19-15.03.30	4.625	15.03.30	USD	150 000	-	-	150 000	125 139.05	0.07
Cbs Out Am 5% 19-15.08.27	5.000	15.08.27	USD	-	225 000	-	225 000	204 550.88	0.11
Cbs Radio I 6.5% 19-01.05.27 144A	6.500	01.05.27	USD	750 000	-	-	750 000	15 041.25	0.01
Ccm Merger 6.375% 20-01.05.26	6.375	01.05.26	USD	75 000	-	-	75 000	72 839.25	0.04
Cco Hldgs 4.25% 20-01.02.31 144A	4.250	01.02.31	USD	775 000	-	-200 000	575 000	466 444.20	0.25
Cco Hldgs 4.25% 21-15.01.34 144A	4.250	15.01.34	USD	575 000	-	-	575 000	435 223.65	0.23
Cco Hldgs 4.50% 20-01.05.32	4.500	01.05.32	USD	725 000	-	-75 000	650 000	519 684.23	0.28
Cco Hldgs 4.50% 20-15.08.30	4.500	15.08.30	USD	725 000	-	-300 000	425 000	354 252.25	0.19
Cco Hldgs 4.50% 21-01.06.33	4.500	01.06.33	USD	325 000	-	-	325 000	255 558.62	0.14
Cco Hldgs 4.75% 19-01.03.30 144A	4.750	01.03.30	USD	500 000	-	-275 000	225 000	192 634.02	0.10
Cco Hldgs 5% 17-01.02.28 144A	5.000	01.02.28	USD	800 000	-	-	800 000	729 754.56	0.39
Cco Hldgs 5.125% 01.05.27 144A	5.125	01.05.27	USD	425 000	-	-	425 000	396 224.48	0.21
Cco Hldgs 5.375% 19-01.06.29 144A	5.375	01.06.29	USD	500 000	-	-400 000	100 000	90 502.35	0.05
Centene Esc 4.25% 19-15.12.27	4.250	15.12.27	USD	550 000	-	-	550 000	516 230.00	0.28
Centene Esc 4.625% 19-15.12.29	4.625	15.12.29	USD	725 000	-	-725 000	-	-	0.00
Centenn 5.375% 17-15.01.26 144A	5.375	15.01.26	USD	-	125 000	-	125 000	119 237.83	0.06
Centennial 6.875% 01.04.27 144A	6.875	01.04.27	USD	575 000	-	-	575 000	568 746.88	0.30
Central Par 7.25% 22-15.06.29	7.250	15.06.29	USD	375 000	175 000	-	550 000	544 988.68	0.29

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Cheever Esc 7.125% 22-01.10.27	7.125	01.10.27	USD	-	200 000	-	200 000	180 499.62	0.10
Chen Eng 3.25% 21-31.01.32	3.250	31.01.32	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Chen Eng 4.0% 21-01.03.31	4.000	01.03.31	USD	575 000	-	-275 000	300 000	264 439.56	0.14
Chen Eng 4.50% 20-01.10.29	4.500	01.10.29	USD	325 000	-	-	325 000	298 504.96	0.16
Cheniere En 4.625% 21-15.10.28	4.625	15.10.28	USD	275 000	-	-	275 000	257 074.65	0.14
Chesapeake 5.875% 21-01.02.29 144A	5.875	01.02.29	USD	75 000	-	-75 000	-	-	0.00
Chs 5.25% 22-15.05.30	5.250	15.05.30	USD	200 000	-	-	200 000	157 749.40	0.08
Chs 6.0% 20-15.01.29 144A	6.000	15.01.29	USD	75 000	-	-	75 000	63 174.38	0.03
Chs 6.125% 21-01.04.30	6.125	01.04.30	USD	400 000	-	-225 000	175 000	104 449.63	0.06
Chs 6.875% 21-15.04.29	6.875	15.04.29	USD	950 000	-	-	950 000	598 243.50	0.32
Chs 8% 19-15.03.26 144A	8.000	15.03.26	USD	325 000	75 000	-50 000	350 000	340 670.82	0.18
Chs 8.0% 19-15.12.27	8.000	15.12.27	USD	125 000	-	-	125 000	120 925.33	0.06
Churchill 6.75% 23-01.05.31	6.750	01.05.31	USD	-	175 000	-	175 000	173 250.00	0.09
Ciena 4.0% 22-31.01.30 144A	4.000	31.01.30	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Civitas Res 8.375% 01.07.28 144A	8.375	01.07.28	USD	-	150 000	-	150 000	151 729.50	0.08
Civitas Res 8.75% 01.07.31 144A	8.750	01.07.31	USD	-	75 000	-	75 000	76 144.50	0.04
Clarivate 4.875% 21-01.07.29 144A	4.875	01.07.29	USD	725 000	-	-	725 000	643 894.69	0.34
Clearwat	5.375	01.02.25	USD	675 000	-	-275 000	400 000	390 600.56	0.21
Clearwat 4.75% 20-15.08.28	4.750	15.08.28	USD	225 000	-	-225 000	-	-	0.00
Cleveland 4.625% 21-01.03.29 144A	4.625	01.03.29	USD	525 000	-	-100 000	425 000	383 233.47	0.20
Cleveland 4.875% 21-1.03.31 144A	4.875	01.03.31	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Clydesdale 8.75% 22-15.04.30 -144A-	8.750	15.04.30	USD	2 150 000	-	-75 000	2 075 000	1 832 512.80	0.98
Cm New Hold 6.75% 19-01.07.26	6.750	01.07.26	USD	376 000	-	-126 000	250 000	172 153.35	0.09
Cmp Cmfz 7.375% 23-01.02.31 144A	7.375	01.02.31	USD	-	300 000	-	300 000	296 044.98	0.16
Cndo M 7.375% 22-15.02.30 144A	7.375	15.02.30	USD	1 500 000	300 000	-	1 800 000	1 566 802.26	0.84
Cnx Mdstm 4.75% 21-15.04.30	4.750	15.04.30	USD	400 000	-	-	400 000	339 682.68	0.18
Coeur Minin 5.125% 21-15.02.29	5.125	15.02.29	USD	525 000	-	-	525 000	433 681.50	0.23
Colt Merger Sub 6.25% 1.07.25 144A	6.250	01.07.25	USD	400 000	-	-	400 000	398 473.52	0.21
Colt Merger Sub 8.125% 1.07.27 144A	8.125	01.07.27	USD	675 000	100 000	-100 000	675 000	691 338.38	0.37
Compass Min	4.875	15.07.24	USD	575 000	-	-575 000	-	-	0.00
Compass Min 6.75% 19-01.12.27	6.750	01.12.27	USD	150 000	-	-150 000	-	-	0.00
Comstock Re 5.875% 21-15.01.30 144A	5.875	15.01.30	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Comstock Re 6.75% 21-01.03.29	6.750	01.03.29	USD	700 000	-	-	700 000	641 314.45	0.34
Consensus 6.0% 21-15.10.26 144A	6.000	15.10.26	USD	325 000	50 000	-	375 000	341 074.93	0.18
Consensus 6.50% 21-15.10.28 144A	6.500	15.10.28	USD	375 000	200 000	-	575 000	492 142.33	0.26
Cornerstone 6.125% 20-15.01.29 144A	6.125	15.01.29	USD	275 000	-	-25 000	250 000	197 911.25	0.11
Cp Atlas Bu 7.0% 20-01.12.28 144A	7.000	01.12.28	USD	1 200 000	-	-300 000	900 000	707 512.50	0.38
Crown Am 5.25% 22-1.04.30 144A	5.250	01.04.30	USD	125 000	-	-125 000	-	-	0.00
Crown Amer/ 4.75% 18-01.02.26	4.750	01.02.26	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Crrcock 5.0% 21-01.05.29	5.000	01.05.29	USD	100 000	-	-	100 000	93 782.00	0.05
Crrcock 5.625% 17-15.10.25 144A	5.625	15.10.25	USD	825 000	-	-	825 000	813 738.75	0.43
Csc Hld 4.125% 20-01.12.30 144A	4.125	01.12.30	USD	900 000	-	-	900 000	630 412.74	0.34
Csc Hld 4.5% 21-15.11.31 144A	4.500	15.11.31	USD	375 000	-	-	375 000	261 792.98	0.14
Csc Hld 4.625% 20-01.12.30 144A	4.625	01.12.30	USD	400 000	-	-	400 000	178 404.46	0.10
Csc Hld Inc 3.375% 15.02.31 144A	3.375	15.02.31	USD	200 000	-	-	200 000	135 571.50	0.07
Csc Hld Inc 5.0% 21-15.11.31	5.000	15.11.31	USD	300 000	-	-	300 000	140 067.87	0.07
Csc Hld Inc 5.75% 19-15.01.30	5.750	15.01.30	USD	1 375 000	-	-150 000	1 225 000	580 141.63	0.31
Csc Hldg	5.500	15.04.27	USD	950 000	-	-125 000	825 000	687 653.84	0.37
Dana Fin Lu 5.75% 17-15.04.25	5.750	15.04.25	USD	400 000	-	-199 000	201 000	198 292.53	0.11
Dana Inc 4.50% 21-15.02.32	4.500	15.02.32	USD	175 000	-	-	175 000	145 446.00	0.08
Davita 4.625% 20-01.06.30	4.625	01.06.30	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Diamond 6.625% 19-15.08.27 144A	6.625	15.08.27	USD	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Diamond Bc 4.625% 21-01.10.29	4.625	01.10.29	USD	850 000	175 000	-	1 025 000	1 034 621.16	0.55
Diamond Spo 5.375% 15.08.26 Regs	5.375	15.08.26	USD	225 000	-	-	225 000	7 734.38	0.00
Diebold Nix 9.375% 20-15.07.25	9.375	15.07.25	USD	150 000	-	-150 000	-	-	0.00
Directv 5.875% 21-15.08.27	5.875	15.08.27	USD	525 000	-	-225 000	300 000	271 990.47	0.15
Dish Dbs	7.750	01.07.26	USD	300 000	-	-	300 000	184 923.00	0.10
Dish Dbs 5.125% 21-01.06.29	5.125	01.06.29	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	511 809.20	0.27
Dish Dbs 5.75% 21-01.12.28	5.750	01.12.28	USD	250 000	-	-125 000	125 000	93 217.13	0.05

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Dish Dbs 7.375% 20-01.07.28	7.375	01.07.28	USD	300 000	-	-	300 000	160 932.00	0.09
Dish Netwrk 11.75% 22-15.11.27	11.750	15.11.27	USD	-	350 000	-	350 000	341 486.39	0.18
Dornoch Deb 6.625% 21-15.10.29	6.625	15.10.29	USD	1 200 000	-	-125 000	1 075 000	878 301.34	0.47
Dt Midstrea 4.375% 21-15.06.31	4.375	15.06.31	USD	275 000	-	-	275 000	237 303.14	0.13
Dun Brads 5.0% 21-15.12.29 144A	5.000	15.12.29	USD	250 000	-	-	250 000	220 700.00	0.12
Edgewell Pe 4.125% 21-01.04.29	4.125	01.04.29	USD	400 000	-	-	400 000	349 450.00	0.19
Eer 6.625% 20-15.07.25 144A	6.625	15.07.25	USD	225 000	-	-225 000	-	-	0.00
Eer Fin 5.75% 17-30.01.28 144A	5.750	30.01.28	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Elastic 4.125% 21-15.07.29	4.125	15.07.29	USD	600 000	50 000	-	650 000	561 327.33	0.30
Eldorado 7.0% 23-15.02.30	7.000	15.02.30	USD	-	225 000	-	225 000	226 155.80	0.12
Elem Sol 3.875% 20-01.09.28 144A	3.875	01.09.28	USD	350 000	-	-	350 000	306 218.08	0.16
Embecta 6.75% 22-15.02.30 144A	6.750	15.02.30	USD	275 000	-	-	275 000	247 529.05	0.13
Embecta Cor 5.0% 22-15.02.30	5.000	15.02.30	USD	150 000	-	-	150 000	124 689.75	0.07
Emerald Deb 6.625% 23-15.12.30	6.625	15.12.30	USD	-	800 000	-	800 000	794 000.00	0.42
Endo 6.0% 20-30.06.28 144A	6.000	30.06.28	USD	356 000	-	-356 000	-	-	0.00
Energizer 4.375% 20-31.03.29	4.375	31.03.29	USD	500 000	-	-	500 000	429 958.00	0.23
Energizer 4.75% 20-15.06.28	4.750	15.06.28	USD	600 000	-	-	600 000	534 000.00	0.28
Energizer 6.50% 22-31.12.27	6.500	31.12.27	USD	150 000	25 000	-	175 000	168 437.07	0.09
Entegris 5.95% 15.06.30 144A	5.950	15.06.30	USD	200 000	350 000	-	550 000	527 935.12	0.28
Enviva 6.50% 19-15.01.26 144A	6.500	15.01.26	USD	900 000	125 000	-	1 025 000	808 479.00	0.43
Eqd Corp 3.625% 21-15.05.31 144A	3.625	15.05.31	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Eqd Mdstm 4.50% 21-15.01.29	4.500	15.01.29	USD	325 000	-	-	325 000	290 180.64	0.15
Eqd Mdstm 4.75% 21-15.01.31	4.750	15.01.31	USD	475 000	-	-	475 000	416 474.30	0.22
Eqd Mdstm 6.0% 20-01.07.25	6.000	01.07.25	USD	92 000	-	-	92 000	91 049.32	0.05
Eqd Mdstm 6.50% 20-01.07.27	6.500	01.07.27	USD	675 000	-	-125 000	550 000	542 996.31	0.29
Eqd Mdstm 7.50% 22-01.06.27	7.500	01.06.27	USD	-	125 000	-	125 000	126 325.25	0.07
Found 6.0% 21-01.03.29	6.000	01.03.29	USD	1 050 000	-	-	1 050 000	878 078.25	0.47
Gap Inc 3.625% 21-01.10.29	3.625	01.10.29	USD	100 000	275 000	-	375 000	265 436.89	0.14
Gap Inc 3.875% 21-01.10.31	3.875	01.10.31	USD	150 000	-	-	150 000	102 645.48	0.05
Garda Ws 4.625% 20-15.02.27 144A	4.625	15.02.27	USD	275 000	-	-275 000	-	-	0.00
Garda Ws 6.0% 21-01.06.29 144A	6.000	01.06.29	USD	650 000	-	-	650 000	533 292.24	0.28
Garda Ws 7.75% 23-15.02.28	7.750	15.02.28	USD	-	150 000	-75 000	75 000	74 526.82	0.04
Garden Spin 8.625% 22-20.07.30	8.625	20.07.30	USD	-	125 000	-	125 000	134 742.64	0.07
Gartner Inc 3.75% 20-01.10.30	3.750	01.10.30	USD	125 000	-	-125 000	-	-	0.00
Gartner Inc 4.50% 20-01.07.28	4.500	01.07.28	USD	150 000	-	-	150 000	140 267.81	0.07
Gates Glob 6.25% 19-15.01.26	6.250	15.01.26	USD	1 600 000	-	-300 000	1 300 000	1 281 732.05	0.68
Glb Med Res 6.50% 20-01.10.25	6.500	01.10.25	USD	1 125 000	-	-725 000	400 000	220 514.00	0.12
Go Daddy Op 5.25% 19-01.12.27	5.250	01.12.27	USD	525 000	-	-	525 000	499 243.50	0.27
Graphic Pac 3.75% 21-01.02.30	3.750	01.02.30	USD	75 000	-	-	75 000	64 783.43	0.03
Gray 4.75% 20-15.10.30 144A	4.750	15.10.30	USD	450 000	-	-275 000	175 000	118 862.63	0.06
Gray Escrow 5.375% 21-15.11.31	5.375	15.11.31	USD	650 000	-	-	650 000	431 682.68	0.23
Gray Tel Ic	5.875	15.07.26	USD	775 000	-	-	775 000	692 484.36	0.37
Gtcr Ap Fin 8% 19-15.05.27 144A	8.000	15.05.27	USD	1 300 000	-	-200 000	1 100 000	1 079 581.14	0.58
Gw B-Cr 9.50% 19-01.11.27	9.500	01.11.27	USD	1 795 000	-	-300 000	1 495 000	1 446 148.33	0.77
Gyp Hldgs I 4.625% 21-01.05.29	4.625	01.05.29	USD	400 000	-	-	400 000	352 798.00	0.19
H&E Equip 3.875% 15.12.28 144A	3.875	15.12.28	USD	925 000	-	-175 000	750 000	650 153.55	0.35
Hb Fuller 4.25% 20-15.10.28	4.250	15.10.28	USD	150 000	-	-	150 000	133 690.50	0.07
Healtheq 4.50% 01.10.29 144A	4.500	01.10.29	USD	525 000	150 000	-	675 000	595 762.97	0.32
Helios Soft 4.625% 21-01.05.28 144A	4.625	01.05.28	USD	525 000	-	-	525 000	447 704.25	0.24
Herens Hold 4.75% 15.05.28 144A	4.750	15.05.28	USD	800 000	75 000	-	875 000	678 995.63	0.36
Hess Midstr 4.25% 21-15.02.30	4.250	15.02.30	USD	250 000	-	-	250 000	218 372.50	0.12
Hess Midstr 5.125% 19-15.06.28	5.125	15.06.28	USD	350 000	-	-	350 000	327 892.55	0.17
Hilton Dome 3.625% 21-15.02.32	3.625	15.02.32	USD	150 000	-	-150 000	-	-	0.00
Hilton Dome 4.875% 19-15.01.30	4.875	15.01.30	USD	175 000	-	-	175 000	163 004.64	0.09
Hilton Dome 5.75% 20-01.05.28	5.750	01.05.28	USD	350 000	-	-	350 000	344 956.47	0.18
Holly 6.375% 22-15.04.27 144A	6.375	15.04.27	USD	225 000	-	-125 000	100 000	98 885.87	0.05
Holly En 5.0% 20-01.02.28	5.000	01.02.28	USD	400 000	-	-	400 000	369 363.97	0.20
Hub Inter 5.625% 21-01.12.29	5.625	01.12.29	USD	900 000	-	-	900 000	807 496.19	0.43
Hub Inter 7% 18-01.05.26 144A	7.000	01.05.26	USD	3 225 000	-	-750 000	2 475 000	2 470 372.49	1.32

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Hub Inter 7.25% 23-15.06.30	7.250	15.06.30	USD	-	275 000	-	275 000	284 572.75	0.15
Iheartcomm 4.75% 19-15.01.28	4.750	15.01.28	USD	375 000	-	-125 000	250 000	188 811.90	0.10
Iheartcomm 5.25% 15.08.27 144A	5.250	15.08.27	USD	125 000	-	-	125 000	95 746.86	0.05
Iho Ver 6.375% 15.05.29 /Pik	6.375	15.05.29	USD	-	300 000	-	300 000	278 957.21	0.15
ii-Vi Inc 5% 21-15.12.29 144A	5.000	15.12.29	USD	675 000	-	-	675 000	610 068.38	0.33
Ims Health	5.000	15.10.26	USD	425 000	-	-	425 000	410 580.01	0.22
Interface 5.50% 20-01.12.28	5.500	01.12.28	USD	150 000	175 000	-	325 000	264 070.59	0.14
Iron 7.0% 23-15.02.29	7.000	15.02.29	USD	-	425 000	-	425 000	426 260.04	0.23
Jazz 4.375% 21-15.01.29 144A	4.375	15.01.29	USD	675 000	-	-200 000	475 000	424 373.61	0.23
Jones 10.50% 22-15.12.30	10.500	15.12.30	USD	-	475 000	-	475 000	479 229.12	0.26
Jones 8.50% 23-15.03.30 144A	8.500	15.03.30	USD	-	500 000	-	500 000	510 677.50	0.27
Kar Auct 5.125% 17-01.06.25 144A	5.125	01.06.25	USD	650 000	-	-573 000	77 000	75 549.80	0.04
Kfc Pizza 4.75% 17-01.06.27	4.750	01.06.27	USD	575 000	-	-	575 000	555 596.63	0.30
Kontoor 4.125% 21-15.11.29	4.125	15.11.29	USD	150 000	25 000	-	175 000	146 328.36	0.08
Koppers 6% 17-15.02.25 144A	6.000	15.02.25	USD	1 150 000	-	-1 150 000	-	-	0.00
Lamar Media 3.625% 21-15.01.31	3.625	15.01.31	USD	125 000	-	-	125 000	105 425.00	0.06
Lamar Media 4.875% 20-15.01.29	4.875	15.01.29	USD	150 000	-	-	150 000	139 743.00	0.07
Ld Holdings 6.125% 21-01.04.28	6.125	01.04.28	USD	550 000	-	-550 000	-	-	0.00
Lender Pro 3.625% 20-01.09.28	3.625	01.09.28	USD	475 000	-	-	475 000	426 312.50	0.23
Lifepoint 6.75% 20-15.04.25 144A	6.750	15.04.25	USD	400 000	-	-	400 000	369 516.00	0.20
Lifepoint 9.75% 18-01.12.26	9.750	01.12.26	USD	650 000	-	-550 000	100 000	83 667.35	0.04
Logan Merge 5.50% 20-01.09.27 144A	5.500	01.09.27	USD	975 000	-	-50 000	925 000	510 429.49	0.27
Madison 4.125% 30.06.28 144A	4.125	30.06.28	USD	75 000	-	-75 000	-	-	0.00
Madison laq 5.875% 21-30.06.29	5.875	30.06.29	USD	1 600 000	-	-75 000	1 525 000	1 237 017.17	0.66
Match 4.125% 20-01.08.30 144A	4.125	01.08.30	USD	350 000	-	-	350 000	300 090.00	0.16
Match 4.625% 20-01.06.28 144A	4.625	01.06.28	USD	150 000	-	-	150 000	137 938.50	0.07
Match Group 5% 17-15.12.27 144A	5.000	15.12.27	USD	450 000	-	-	450 000	417 784.46	0.22
Match Grp H 3.625% 21-01.10.31	3.625	01.10.31	USD	350 000	-	-	350 000	286 668.90	0.15
Mauser 9.25% 23-15.04.27 144A	9.250	15.04.27	USD	-	750 000	-375 000	375 000	346 520.70	0.18
Mednax Inc 5.375% 22-15.02.30	5.375	15.02.30	USD	350 000	-	-350 000	-	-	0.00
Midas 5.625% 21-15.08.29 144A	5.625	15.08.29	USD	1 075 000	-	-	1 075 000	921 154.06	0.49
Midwest Gam 4.875% 21-01.05.29	4.875	01.05.29	USD	375 000	-	-	375 000	331 480.49	0.18
Millenniu 6.625% 21-01.08.26 144A	6.625	01.08.26	USD	350 000	-	-	350 000	257 977.20	0.14
Minerva Mer 6.50% 22-15.02.30	6.500	15.02.30	USD	1 650 000	175 000	-	1 825 000	1 537 875.31	0.82
Miwd Hld /Mi 5.50% 22-01.02.30	5.500	01.02.30	USD	100 000	-	-	100 000	82 629.00	0.04
Moheg Gam 8.0% 21-01.02.26	8.000	01.02.26	USD	1 375 000	-	-350 000	1 025 000	979 848.75	0.52
Mozart Debt 3.875% 21-01.04.29	3.875	01.04.29	USD	500 000	-	-	500 000	433 740.25	0.23
Mozart Debt 5.25% 21-01.10.29	5.250	01.10.29	USD	1 800 000	-	-	1 800 000	1 563 665.58	0.83
Mph Acqui 5.50% 21-01.09.28 144A	5.500	01.09.28	USD	275 000	-	-275 000	-	-	0.00
Mph Merger	5.750	01.11.28	USD	1 450 000	-	-1 275 000	175 000	131 929.00	0.07
Nabors Ind 7.25% 20-15.01.26 144A	7.250	15.01.26	USD	425 000	-	-75 000	350 000	327 150.25	0.17
Nabors Ind 7.375% 21-15.05.27	7.375	15.05.27	USD	50 000	-	-	50 000	47 624.00	0.03
Nabors Ind 7.50% 20-15.01.28 144A	7.500	15.01.28	USD	350 000	-	-200 000	150 000	132 558.00	0.07
Nationl Fin 6.875% 20-15.08.28	6.875	15.08.28	USD	2 325 000	-	-400 000	1 925 000	1 674 046.03	0.89
Nationl Fin 7.50% 22-01.10.30	7.500	01.10.30	USD	-	250 000	-	250 000	242 276.35	0.13
Ncr Corp 5.0% 20-01.10.28	5.000	01.10.28	USD	250 000	-	-	250 000	223 352.68	0.12
Ncr Corp 5.125% 21-15.04.29 144A	5.125	15.04.29	USD	300 000	-	-	300 000	265 868.85	0.14
Ncr Corp 5.25% 20-01.10.30	5.250	01.10.30	USD	325 000	-	-	325 000	283 017.02	0.15
Ncr Corp 5.75% 19-01.09.27 144A	5.750	01.09.27	USD	375 000	-	-	375 000	375 409.16	0.20
Ncr Corp 6.125% 19-01.09.29 144A	6.125	01.09.29	USD	150 000	-	-	150 000	150 267.00	0.08
News Corp 5.125% 22-15.02.32	5.125	15.02.32	USD	75 000	-	-75 000	-	-	0.00
Nexstar 5.625% 19-15.07.27 144A	5.625	15.07.27	USD	925 000	-	-	925 000	863 278.91	0.46
Nexstar Bro 4.75% 20-01.11.28	4.750	01.11.28	USD	675 000	-	-500 000	175 000	152 045.93	0.08
Niel Fin 4.50% 21-15.07.29	4.500	15.07.29	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Niel Fin 4.75% 21-15.07.31	4.750	15.07.31	USD	275 000	-	-275 000	-	-	0.00
Niel Fin 5.625% 20-01.10.28	5.625	01.10.28	USD	125 000	-	-125 000	-	-	0.00
Niel Fin 5.875% 20-01.10.30	5.875	01.10.30	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Nielsen 5% 17-01.02.25 144A	5.000	01.02.25	USD	475 000	-	-475 000	-	-	0.00
Nmg Hldg 7.125% 01.04.26 144A	7.125	01.04.26	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Nrg Energy 3.875% 15.02.32	3.875	15.02.32	USD	800 000	-	-200 000	600 000	462 969.18	0.25
Nrg Energy 6.625% 17-15.01.27	6.625	15.01.27	USD	122 000	-	-	122 000	121 155.70	0.06
Oasis Midst 8.0% 01.04.29 144A	8.000	01.04.29	USD	350 000	-	-	350 000	355 087.50	0.19
Oasis Ptrlm 6.375% 01.06.26 144A	6.375	01.06.26	USD	100 000	-	-	100 000	99 051.97	0.05
Oi European 4.75% 15.02.30 144A	4.750	15.02.30	USD	450 000	-	-	450 000	403 304.88	0.22
Olympus Wat 4.25% 21-01.10.28	4.250	01.10.28	USD	350 000	75 000	-	425 000	336 155.32	0.18
Olympus Wat 6.25% 21-01.10.29	6.250	01.10.29	USD	575 000	-	-	575 000	416 187.88	0.22
Olympus Wat 9.75% 23-15.11.28	9.750	15.11.28	USD	-	325 000	-	325 000	317 590.00	0.17
Open 4.125% 21-01.12.31 144A	4.125	01.12.31	USD	525 000	-	-	525 000	430 737.20	0.23
Open Text 3.875% 20-15.02.28 144A	3.875	15.02.28	USD	-	100 000	-	100 000	88 166.00	0.05
Open Text 6.90% 22-01.12.27	6.900	01.12.27	USD	-	175 000	-	175 000	178 363.50	0.10
Organon 4.125% 21-30.04.28 144A	4.125	30.04.28	USD	200 000	-	-	200 000	177 719.12	0.09
Organon Fin 5.125% 21-30.04.31	5.125	30.04.31	USD	550 000	-	-	550 000	454 494.04	0.24
Outfrnt Md 4.25% 21-15.01.29 144A	4.250	15.01.29	USD	125 000	-	-	125 000	105 177.50	0.06
Ow Br 7.25% 23-15.05.31 144A	7.250	15.05.31	USD	-	375 000	-	375 000	380 156.25	0.20
Ow-Br Gls	6.375	15.08.25	USD	50 000	-	-	50 000	50 186.25	0.03
Ow-Br Gls	5.375	15.01.25	USD	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Ow-Br Gls 6.625% 20-13.05.27 144A	6.625	13.05.27	USD	94 000	75 000	-	169 000	167 595.39	0.09
Oxy 6.45% 19-15.09.36	6.450	15.09.36	USD	150 000	-	-150 000	-	-	0.00
Panther Bf 6.25% 19-15.05.26	6.250	15.05.26	USD	113 000	-	-113 000	-	-	0.00
Panther Bf 8.5% 19-15.05.27 144A	8.500	15.05.27	USD	2 275 000	-	-150 000	2 125 000	2 132 603.25	1.14
Pbh 3.75% 21-01.04.31	3.750	01.04.31	USD	175 000	-	-175 000	-	-	0.00
Pdc Energy 5.75% 18-15.05.26	5.750	15.05.26	USD	400 000	-	-	400 000	398 758.63	0.21
Pdc Energy 6.125% 17-15.09.24	6.125	15.09.24	USD	87 000	-	-	87 000	87 034.30	0.05
Penn 4.125% 21-01.07.29	4.125	01.07.29	USD	150 000	200 000	-	350 000	287 315.00	0.15
Penn 5.625% 17-15.01.27 144A	5.625	15.01.27	USD	50 000	-	-	50 000	46 812.29	0.02
Perf Food G 4.25% 21-01.08.29	4.250	01.08.29	USD	350 000	-	-	350 000	312 014.71	0.17
Poindexter 7.125% 18-15.04.26	7.125	15.04.26	USD	225 000	-	-225 000	-	-	0.00
Polar Us Bo 6.75% 21-15.05.26	6.750	15.05.26	USD	675 000	-	-250 000	425 000	251 794.20	0.13
Post 4.625% 20-15.04.30 144A	4.625	15.04.30	USD	325 000	-	-325 000	-	-	0.00
Post HI 5.625% 17-15.01.28 144A	5.625	15.01.28	USD	475 000	-	-150 000	325 000	312 805.70	0.17
Post Hldg 4.50% 21-15.09.31	4.500	15.09.31	USD	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Post Hldg 5.5% 19-15.12.29	5.500	15.12.29	USD	75 000	125 000	-	200 000	184 805.94	0.10
Post Hldg 5.75% 17-01.03.27 144A	5.750	01.03.27	USD	433 000	-	-	433 000	423 262.57	0.23
Precisn 6.875% 21-15.01.29	6.875	15.01.29	USD	450 000	-	-	450 000	406 847.50	0.22
Precisn 7.125% 17-15.01.26 144A	7.125	15.01.26	USD	75 000	50 000	-50 000	75 000	74 148.58	0.04
Quicken Loa 3.625% 20-01.03.29	3.625	01.03.29	USD	250 000	-	-	250 000	210 359.50	0.11
Quicken Loa 3.875% 20-01.03.31	3.875	01.03.31	USD	650 000	-	-	650 000	527 642.38	0.28
Quintiles 5% 19-15.05.27 144A	5.000	15.05.27	USD	200 000	-	-	200 000	192 570.56	0.10
Racksp Host 3.50% 21-15.02.28	3.500	15.02.28	USD	675 000	-	-125 000	550 000	248 087.41	0.13
Racksp Host 5.375% 20-01.12.28	5.375	01.12.28	USD	975 000	-	-325 000	650 000	202 875.27	0.11
Range Resou 4.75% 22-15.02.30	4.750	15.02.30	USD	175 000	-	-100 000	75 000	67 294.88	0.04
Range Resou 5% 17-15.03.23	5.000	15.03.23	USD	113 000	-	-113 000	-	-	0.00
Range Resou 8.25% 21-15.01.29	8.250	15.01.29	USD	225 000	-	-	225 000	233 614.94	0.12
Raptor Acqn 4.875% 21-01.11.26	4.875	01.11.26	USD	50 000	175 000	-	225 000	212 265.00	0.11
Rattler Mid 5.625% 20-15.07.25	5.625	15.07.25	USD	225 000	-	-225 000	-	-	0.00
Redwood 8.75% 22-1.04.30 144A	8.750	01.04.30	USD	825 000	-	-	825 000	743 447.27	0.40
Regional 5.375% 20-15.01.29	5.375	15.01.29	USD	525 000	-	-	525 000	299 252.47	0.16
Rhp 7.25% 23-15.07.28	7.250	15.07.28	USD	-	100 000	-	100 000	101 238.00	0.05
Ritchie Bro 6.75% 15.03.28 144A	6.750	15.03.28	USD	-	125 000	-	125 000	126 132.15	0.07
Ritchie Bro 7.75% 15.03.31 144A	7.750	15.03.31	USD	-	100 000	-	100 000	103 867.09	0.06
RI Hero Mrg 6.25% 21-01.02.29	6.250	01.02.29	USD	1 575 000	-	-675 000	900 000	738 999.00	0.39
Roblox 3.875% 21-01.05.30	3.875	01.05.30	USD	425 000	-	-	425 000	358 672.38	0.19
Rockcliff E 5.50% 15.10.29 144A	5.500	15.10.29	USD	325 000	-	-25 000	300 000	277 041.00	0.15
Rocket Mort 2.875% 21-15.10.26	2.875	15.10.26	USD	450 000	-	-	450 000	398 724.75	0.21
Rocket Mort 4.0% 15.10.33 144A	4.000	15.10.33	USD	350 000	-	-	350 000	274 116.50	0.15
Rocket Soft 6.50% 21-15.02.29	6.500	15.02.29	USD	975 000	50 000	-	1 025 000	863 690.52	0.46
Ryan Specia 4.375% 22-01.02.30	4.375	01.02.30	USD	200 000	100 000	-	300 000	265 935.00	0.14
Sc Games HI 6.625% 22-01.03.30	6.625	01.03.30	USD	475 000	50 000	-	525 000	462 485.63	0.25

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Sci Games 7.25% 19-15.11.29	7.250	15.11.29	USD	200 000	-	-	200 000	200 430.00	0.11
Sci Games 8.625% 20-01.07.25	8.625	01.07.25	USD	475 000	100 000	-	575 000	587 735.10	0.31
Science App 4.875% 20-01.04.28	4.875	01.04.28	USD	125 000	-	-	125 000	116 374.42	0.06
Scripps Esc 3.875% 20-15.01.29	3.875	15.01.29	USD	125 000	-	-125 000	-	-	0.00
Scripps Esc 5.375% 15.01.31 144A	5.375	15.01.31	USD	275 000	-	-100 000	175 000	123 450.87	0.07
Scripps Esc 5.875% 15.07.27 144A	5.875	15.07.27	USD	625 000	-	-225 000	400 000	324 329.35	0.17
Seagate Hdd 3.125% 20-15.07.29	3.125	15.07.29	USD	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Seagate Hdd 3.375% 20-15.07.31	3.375	15.07.31	USD	325 000	-	-325 000	-	-	0.00
Seagate Hdd 8.50% 23-15.07.31	8.500	15.07.31	USD	-	200 000	-	200 000	209 976.00	0.11
Sealed Air 4.0% 19-01.12.27	4.000	01.12.27	USD	325 000	-	-	325 000	295 750.00	0.16
Sealed Air 6.125% 23-01.02.28	6.125	01.02.28	USD	-	100 000	-	100 000	99 366.67	0.05
Seaworld Pa 5.25% 21-15.08.29	5.250	15.08.29	USD	900 000	-	-	900 000	806 433.08	0.43
Sensata 4.375% 19-15.02.30 144A	4.375	15.02.30	USD	175 000	-	-	175 000	156 474.47	0.08
Sensata 5.875% 22-01.09.30 144A	5.875	01.09.30	USD	-	200 000	-	200 000	194 670.00	0.10
Sensata Tec 3.75% 20-15.02.31	3.750	15.02.31	USD	75 000	-	-	75 000	64 067.09	0.03
Signal Pare 6.125% 21-01.04.29	6.125	01.04.29	USD	650 000	-	-375 000	275 000	153 661.75	0.08
Sinclair	5.125	15.02.27	USD	1 000 000	-	-475 000	525 000	445 494.00	0.24
Sinclair 5.5% 19-01.03.30	5.500	01.03.30	USD	425 000	125 000	-	550 000	317 776.25	0.17
Sirius Xm 3.125% 21-01.09.26	3.125	01.09.26	USD	450 000	-	-100 000	350 000	313 718.79	0.17
Sirius Xm 3.875% 21-01.09.31	3.875	01.09.31	USD	1 025 000	-	-200 000	825 000	639 095.28	0.34
Sirius Xm 4.0% 21-15.07.28	4.000	15.07.28	USD	300 000	-	-	300 000	258 713.79	0.14
Sirius Xm 4.125% 20-01.07.30	4.125	01.07.30	USD	275 000	-	-75 000	200 000	163 507.44	0.09
Sirius Xm 5.50% 19-01.07.29	5.500	01.07.29	USD	350 000	-	-100 000	250 000	225 054.23	0.12
Six Flags 5.5% 17-15.04.27	5.500	15.04.27	USD	650 000	-	-650 000	-	-	0.00
Six Flags E 7.25% 23-15.05.31	7.250	15.05.31	USD	-	350 000	-	350 000	341 216.05	0.18
Sm Energy 6.625% 18-15.01.27	6.625	15.01.27	USD	75 000	-	-	75 000	72 911.25	0.04
Solaris Mid 7.625% 21-01.04.26	7.625	01.04.26	USD	250 000	-	-	250 000	242 186.04	0.13
Spcm Sa 3.375% 21-15.03.30	3.375	15.03.30	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Srs Distrib 6.0% 21-01.12.29	6.000	01.12.29	USD	750 000	175 000	-	925 000	799 657.88	0.43
Srs Distrib 6.125% 01.07.29 144A	6.125	01.07.29	USD	475 000	200 000	-	675 000	583 832.54	0.31
Ss&C Tech I 5.5% 19-30.09.27 144A	5.500	30.09.27	USD	1 025 000	-	-125 000	900 000	862 831.45	0.46
Stand In 4.75% 17-15.01.28 144A	4.750	15.01.28	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Stand Ind 5% 17-15.02.27 144A	5.000	15.02.27	USD	1 150 000	-	-	1 150 000	1 097 219.49	0.59
Standard In 3.375% 20-15.01.31	3.375	15.01.31	USD	425 000	-	-125 000	300 000	241 948.94	0.13
Standard In 4.375% 20-15.07.30	4.375	15.07.30	USD	250 000	-	-75 000	175 000	151 711.23	0.08
Station 4.50% 20-15.02.28	4.500	15.02.28	USD	300 000	-	-	300 000	269 635.50	0.14
Station 4.625% 21-01.12.31	4.625	01.12.31	USD	400 000	-	-	400 000	337 418.00	0.18
Stena Intl 6.125% 20-01.02.25 144A	6.125	01.02.25	USD	425 000	-	-	425 000	416 042.24	0.22
Sthwest En 8.375% 20-15.09.28	8.375	15.09.28	USD	275 000	-	-	275 000	286 460.63	0.15
Suburb Prop 5.0% 21-01.06.31 144A	5.000	01.06.31	USD	375 000	-	-	375 000	314 499.14	0.17
Suburb Prop 5.875% 17-01.03.27	5.875	01.03.27	USD	250 000	-	-	250 000	241 768.81	0.13
Summit Mid 5.75% 17-15.04.25	5.750	15.04.25	USD	550 000	-	-225 000	325 000	295 636.25	0.16
Synaptics 4.0% 21-15.06.29 144A	4.000	15.06.29	USD	150 000	-	-	150 000	126 087.59	0.07
Syneos 3.625% 20-15.01.29 144A	3.625	15.01.29	USD	475 000	-	-475 000	-	-	0.00
Tap Rock 7.0% 21-01.10.26	7.000	01.10.26	USD	400 000	-	-	400 000	412 360.00	0.22
Targa Res 5% 17-15.01.28	5.000	15.01.28	USD	75 000	-	-75 000	-	-	0.00
Targa Res 5.50% 19-01.03.30	5.500	01.03.30	USD	600 000	-	-300 000	300 000	289 000.50	0.15
Targa Res Par 6.5% 19-15.07.27	6.500	15.07.27	USD	250 000	-	-	250 000	248 427.98	0.13
Tegna 4.625% 20-15.03.28	4.625	15.03.28	USD	75 000	-	-	75 000	66 468.75	0.04
Tegna 5% 19-15.09.29	5.000	15.09.29	USD	1 000 000	-	-100 000	900 000	776 938.62	0.41
Telenet 5.5% 17-01.03.28	5.500	01.03.28	USD	1 200 000	-	-	1 200 000	1 109 760.00	0.59
Tenet 4.625% 20-15.06.28 144A	4.625	15.06.28	USD	50 000	-	-50 000	-	-	0.00
Tenet 6.125% 22-15.06.30 144A	6.125	15.06.30	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Tenet Health 6.125% 01.10.28	6.125	01.10.28	USD	-	725 000	-	725 000	698 653.50	0.37
Tenet Health 6.125% 22-15.06.30	6.125	15.06.30	USD	-	100 000	-	100 000	98 655.00	0.05
Tenet Health 6.25% 01.02.27	6.250	01.02.27	USD	-	375 000	-	375 000	371 505.53	0.20
Tenet Hlthc 4.875% 19-01.01.26	4.875	01.01.26	USD	350 000	-	-350 000	-	-	0.00
Tenet Hlthc 4.875% 23-01.01.26	4.875	01.01.26	USD	-	350 000	-	350 000	341 228.06	0.18
Tenet Hlthc 5.125% 19-01.11.27	5.125	01.11.27	USD	425 000	-	-425 000	-	-	0.00

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Tenet Hlthc 5.125% 19-01.11.27	5.125	01.11.27	USD	-	425 000	-	425 000	406 130.17	0.22
Tenet Hlthc 6.125% 20-01.10.28	6.125	01.10.28	USD	850 000	-	-850 000	-	-	0.00
Tenet Hlthc 6.25% 19-01.02.27 144A	6.250	01.02.27	USD	350 000	125 000	-475 000	-	-	0.00
Tenn Mrgr 6.375% 17-01.02.25 144A	6.375	01.02.25	USD	550 000	-	-550 000	-	-	0.00
Terraform 4.75% 19-15.01.30	4.750	15.01.30	USD	550 000	-	-100 000	450 000	397 559.25	0.21
Terraform 5% 17-31.01.28 144A	5.000	31.01.28	USD	600 000	-	-	600 000	552 984.00	0.29
Terrier M B 8.875% 19-15.12.27	8.875	15.12.27	USD	1 550 000	-	-200 000	1 350 000	946 715.58	0.50
Tex Op 5.625% 19-15.02.27 144A	5.625	15.02.27	USD	350 000	-	-	350 000	335 742.44	0.18
Tibco 6.50% 22-31.03.29 144A	6.500	31.03.29	USD	-	850 000	-	850 000	757 660.10	0.40
Tibco Soft 9.0% 23-30.09.29	9.000	30.09.29	USD	-	425 000	-	425 000	369 851.75	0.20
Transalta 7.75% 22-15.11.29	7.750	15.11.29	USD	-	200 000	-	200 000	206 101.00	0.11
Transdigm 4.625% 21-15.01.29	4.625	15.01.29	USD	375 000	-	-375 000	-	-	0.00
Transdigm 4.875% 21-01.05.29	4.875	01.05.29	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Transdigm 6.25% 19-15.03.26 144A	6.250	15.03.26	USD	850 000	125 000	-	975 000	971 053.98	0.52
Transdigm 6.75% 15.08.28 144A	6.750	15.08.28	USD	-	200 000	-	200 000	201 028.60	0.11
Transmontai 6.125% 18-15.02.26	6.125	15.02.26	USD	300 000	-	-	300 000	259 887.64	0.14
Transocean 8.375% 23-01.02.28	8.375	01.02.28	USD	-	25 000	-25 000	-	-	0.00
Trident 6.625% 17-01.11.25 144A	6.625	01.11.25	USD	675 000	-	-675 000	-	-	0.00
Trident Tpi 9.25% 19-01.08.24 144A	9.250	01.08.24	USD	425 000	50 000	-475 000	-	-	0.00
Trivium Pack 8.50% 15.08.27 144A	8.500	15.08.27	USD	1 200 000	-	-	1 200 000	1 156 604.04	0.62
Ttm Tech 4.0% 21-01.03.29	4.000	01.03.29	USD	350 000	50 000	-	400 000	340 404.19	0.18
Twitter 5.0% 22-01.03.30	5.000	01.03.30	USD	175 000	-	-175 000	-	-	0.00
United Shor 5.50% 20-15.11.25	5.500	15.11.25	USD	800 000	-	-	800 000	762 216.56	0.41
United Shor 5.50% 21-15.04.29	5.500	15.04.29	USD	700 000	-	-	700 000	600 943.00	0.32
United Shor 5.75% 21-15.06.27	5.750	15.06.27	USD	250 000	-	-	250 000	228 495.00	0.12
Univis 7.375% 22-30.06.30 144A	7.375	30.06.30	USD	125 000	200 000	-	325 000	309 760.85	0.17
Univision 4.5% 21-01.05.29 144A	4.500	01.05.29	USD	325 000	-	-	325 000	279 637.80	0.15
Upc Broad F 4.875% 21-15.07.31 144A	4.875	15.07.31	USD	1 175 000	-	-	1 175 000	968 458.50	0.52
Urban One 7.375% 21-01.02.28 144A	7.375	01.02.28	USD	500 000	-	-	500 000	436 105.00	0.23
Us Foods 4.625% 21-01.06.30	4.625	01.06.30	USD	200 000	-	-75 000	125 000	112 160.86	0.06
Us Foods 4.75% 21-15.02.29	4.750	15.02.29	USD	725 000	-	-	725 000	664 419.36	0.35
Usa Compres 6.875% 19-01.09.27	6.875	01.09.27	USD	675 000	-	-225 000	450 000	430 165.40	0.23
Usagm Holdc 6.625% 19-15.07.26	6.625	15.07.26	USD	150 000	-	-	150 000	142 531.83	0.08
Usis Me 6.875% 17-01.05.25 144A	6.875	01.05.25	USD	1 450 000	150 000	-	1 600 000	1 590 096.00	0.85
Valeant 5.5% 17-01.11.25 144A	5.500	01.11.25	USD	475 000	-	-475 000	-	-	0.00
Valeant 8.5% 18-31.01.27 144A	8.500	31.01.27	USD	850 000	-	-650 000	200 000	109 742.00	0.06
Valeant 9% 17-15.12.25 144A	9.000	15.12.25	USD	275 000	-	-275 000	-	-	0.00
Valeant 9.25% 18-01.04.26	9.250	01.04.26	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Vertical Ho 7.625% 20-15.07.28 144A	7.625	15.07.28	USD	400 000	-	-100 000	300 000	272 655.56	0.15
Vertical Us 5.25% 20-15.07.27	5.250	15.07.27	USD	850 000	-	-400 000	450 000	416 349.23	0.22
Viavi Solut 3.75% 21-01.10.29	3.750	01.10.29	USD	100 000	-	-	100 000	85 053.36	0.05
Vici Pr 3.875% 22-15.02.29 144A	3.875	15.02.29	USD	50 000	-	-50 000	-	-	0.00
Vici Pro 4.25% 19-01.12.26 144A	4.250	01.12.26	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Vici Prop 3.5% 20-15.02.25	3.500	15.02.25	USD	50 000	-	-	50 000	47 820.73	0.03
Vici Prop 4.625% 19-1.12.29 144A	4.625	01.12.29	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Vici Proper 4.625% 21-15.06.25 144A	4.625	15.06.25	USD	75 000	-	-	75 000	72 535.89	0.04
Vici Proper 5.625% 21-01.05.24 144A	5.625	01.05.24	USD	200 000	-	-	200 000	198 923.90	0.11
Virgin Med 5% 20-15.07.30 144A	5.000	15.07.30	USD	600 000	-	-	600 000	478 187.88	0.25
Vistra Ope 5.5% 18-01.09.26 144A	5.500	01.09.26	USD	250 000	-	-	250 000	240 810.70	0.13
Vistra Oper 5% 19-31.07.27 144A	5.000	31.07.27	USD	225 000	-	-	225 000	210 804.68	0.11
Vmed 4.50% 20-15.08.30 144A	4.500	15.08.30	USD	275 000	-	-75 000	200 000	167 844.08	0.09
Vmed O2 Uk 4.25% 20-31.01.31	4.250	31.01.31	USD	200 000	-	-	200 000	161 925.14	0.09
Vmed O2 Uk 4.75% 15.07.31 144A	4.750	15.07.31	USD	875 000	-	-300 000	575 000	478 797.27	0.26
Vz Secured 5.0% 22-15.01.32	5.000	15.01.32	USD	250 000	-	-	250 000	201 614.13	0.11
Watco Comp 6.50% 20-15.06.27	6.500	15.06.27	USD	600 000	-	-	600 000	570 938.24	0.30
Wesco 7.125% 20-15.06.25 144A	7.125	15.06.25	USD	100 000	-	-	100 000	101 136.30	0.05
Wesco 7.25% 20-15.06.28 144A	7.250	15.06.28	USD	300 000	-	-100 000	200 000	204 195.60	0.11
Western Gas 4.05% 20-01.02.30	4.050	01.02.30	USD	125 000	-	-	125 000	112 494.88	0.06
White Cap B 6.875% 20-15.10.28	6.875	15.10.28	USD	725 000	-	-	725 000	657 999.13	0.35

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
White Cap P 8.25% 15.03.26/Pik	8.250	15.03.26	USD	575 000	-	-150 000	425 000	407 560.13	0.22
William Car 5.625% 15.03.27 144A	5.625	15.03.27	USD	75 000	-	-75 000	-	-	0.00
Wmg Acq 3.75% 21-01.12.29	3.750	01.12.29	USD	275 000	-	-	275 000	237 786.51	0.13
Wr Grace Ho 5.625% 21-15.08.29	5.625	15.08.29	USD	375 000	-	-	375 000	307 593.75	0.16
Wr Grace Ho 7.375% 23-01.03.31	7.375	01.03.31	USD	-	150 000	-	150 000	147 132.18	0.08
Wyndham 4.375% 20-15.08.28	4.375	15.08.28	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Yum Brands 4.75% 19-15.01.30	4.750	15.01.30	USD	100 000	-	-	100 000	93 738.50	0.05
Zf Na Cap 6.875% 14.04.28 144A	6.875	14.04.28	USD	-	150 000	-	150 000	152 084.31	0.08
Zf Na Capit 7.125% 23-14.04.30	7.125	14.04.30	USD	-	150 000	-	150 000	152 734.65	0.08
Ziprecrute 5% 22-15.01.30 144A	5.000	15.01.30	USD	150 000	150 000	-	300 000	255 747.00	0.14
								148 838 972.95	79.39
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								148 838 972.95	79.39
Sonstige übertragbare Wertpapiere									
Aktien									
Mallinckrodt Plc			USD	17 308	-	-17 308	-	-	0.00
Rights Intelsat Ja			USD	893	-	-	893	4 241.75	0.00
								4 241.75	0.00
Anleihen									
Dana Inc 4.25% 21-01.09.30	4.250	01.09.30	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Int8. 5% 15.10.24 /Escrow Dfit144a	5.000	15.10.24	USD	275 000	-	-	275 000	-	0.00
Intel 9.75% 15.07.25 /Escrow 144A	9.750	15.07.25	USD	200 000	-	-	200 000	-	0.00
Intelsat Jacks 01.08.23 /Escrow	5.500	01.08.23	USD	425 000	-	-	425 000	-	0.00
Mallinckrd 10% 22-15.06.29 144A	10.000	15.06.29	USD	491 000	1 819	-492 819	-	-	0.00
								-	0.00
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere								4 241.75	0.00
SUMME WERTPAPIERBESTAND								179 936 185.70	95.98
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								5 053 412.34	2.70
Sonstige Aktiven								2 476 409.28	1.32
GESAMTNETTOVERMÖGEN								187 466 007.32	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Total Return Global

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
10 Renew Pw 4.50% 21-14.07.28	4.500	14.07.28	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 279 381.76	0.30
7-Eleven In 1.80% 10.02.31 Regs	1.800	10.02.31	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 373 398.31	0.55
Abertis Fin 2.625% 21-Perp	2.625	31.12.99	EUR	3 000 000	-	-	3 000 000	2 724 261.91	0.63
Alfa	6.875	25.03.44	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	2 011 990.00	0.47
Alibaba Grp	3.600	28.11.24	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	968 914.47	0.22
Alibaba Grp 2.70% 21-09.02.41	2.700	09.02.41	USD	5 000 000	-	-	5 000 000	3 337 704.85	0.77
Argentum Nethld 5.625% 16-15.08.52	5.625	15.08.52	USD	800 000	-	-	800 000	755 932.80	0.18
Australia 0.50% 20-21.09.26	0.500	21.09.26	AUD	35 000 000	-	-35 000 000	-	-	0.00
Australia 1% 19-21.12.30	1.000	21.12.30	AUD	54 000 000	-	-14 000 000	40 000 000	21 518 630.50	4.99
Australia 1.25% 19-21.05.32	1.250	21.05.32	AUD	5 000 000	14 700 000	-	19 700 000	10 422 576.24	2.42
Australia 1.5% 21.11.31	1.500	21.11.31	AUD	40 000 000	-	-	40 000 000	20 960 830.71	4.86
Australia 2.75% 18-21.05.41	2.750	21.05.41	AUD	-	11 000 000	-	11 000 000	5 910 499.01	1.37
Australia 3.75% 14-21.04.37	3.750	21.04.37	AUD	-	19 000 000	-	19 000 000	12 108 638.02	2.81
Baidu Inc 1.72% 20-09.04.26	1.720	09.04.26	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	897 208.95	0.21
Baidu Inc 2.375% 21-23.08.31	2.375	23.08.31	USD	5 000 000	-	-1 000 000	4 000 000	3 236 300.28	0.75
Ball Corp 2.875% 20-15.08.30	2.875	15.08.30	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 658 834.40	0.38
Bharat Petr	4.000	08.05.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	966 171.91	0.22
Boardwalk 4.80% 19-03.05.29	4.800	03.05.29	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	959 445.32	0.22
Bpcm 3.25% 20-Perp	3.250	31.12.99	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	2 015 983.97	0.47
Bpnl Intern 4.375% 17-18.01.27	4.375	18.01.27	USD	1 300 000	-	-	1 300 000	1 241 590.77	0.29
Brf 4.875% 19-24.01.30 Regs	4.875	24.01.30	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Brf GmbH	4.350	29.09.26	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Cat Pac Mtn 4.875% 21-17.08.26	4.875	17.08.26	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 940 152.78	0.45
Celanese Us 4.777% 22-19.07.26	4.777	19.07.26	EUR	-	2 000 000	-1 000 000	1 000 000	1 065 887.36	0.25
Celanese Us 5.90% 22-05.07.24	5.900	05.07.24	USD	-	250 000	-	250 000	249 534.61	0.06
Celanese Us 6.165% 22-15.07.27	6.165	15.07.27	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	997 312.33	0.23
Cellnex Fin 1.50% 21-08.06.28	1.500	08.06.28	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	933 885.09	0.22
Charter Com 3.50% 21-01.03.42	3.500	01.03.42	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 337 590.14	0.31
Charter Com 3.70% 20-01.04.51	3.700	01.04.51	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Cloverie	5.625	24.06.46	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 957 370.00	0.69
Cloverie Pl	4.500	11.09.44	USD	400 000	-	-	400 000	382 405.20	0.09
Colombia 3.125% 20-15.04.31	3.125	15.04.31	USD	4 000 000	-	-	4 000 000	3 040 948.48	0.71
Colombia 8.125% 04-21.05.24	8.125	21.05.24	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 021 005.00	0.24
Contnm E 4.5% 09.02.27/Pool Regs	4.500	09.02.27	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	867 225.00	0.20
Cosan	8.250	29.11.49	USD	1 200 000	-	-	1 200 000	1 194 197.93	0.28
Count Gard 6.15% 19-17.09.25	6.150	17.09.25	USD	2 000 000	-	-1 000 000	1 000 000	330 456.67	0.08
Crown Euro. 3.38% 15-15.05.25	3.380	15.05.25	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	1 071 088.16	0.25
Cvs Health 4.875% 15-20.07.35	4.875	20.07.35	USD	500 000	-	-	500 000	475 258.00	0.11
Demeter Inv 4.625% 17-Perp	4.625	31.12.99	USD	2 300 000	-	-	2 300 000	2 005 549.40	0.47
Deut Lufth 3.0% 20-29.05.26	3.000	29.05.26	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	1 039 226.60	0.24
Deut Lufth 3.75% 21-11.02.28	3.750	11.02.28	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Ebrd 5.0% 19-05.11.24	5.000	05.11.24	RUB	200 000 000	-	-100 000 000	100 000 000	996 564.56	0.23
Edp 4.496% 19-30.04.79	4.496	30.04.79	EUR	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Elm For Fir 3.75% 20-Perp	3.750	31.12.99	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	2 091 189.52	0.48
Enel	8.750	24.09.73	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 998 133.90	0.46
Eqf Mdstm 4.125% 16-01.12.26	4.125	01.12.26	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 396 843.26	0.32
Eurofins 3.25% 17-Perp Regs	3.250	31.12.99	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	1 008 123.28	0.23
Fedex Corp 4.05% 18-15.02.48	4.050	15.02.48	USD	2 000 000	-	-500 000	1 500 000	1 198 285.61	0.28
Frs Med Care 2.375% 16.02.31	2.375	16.02.31	USD	2 300 000	-	-	2 300 000	1 745 722.01	0.40
Greenko 3.85% 29.03.26 /Pool	3.850	29.03.26	USD	2 890 000	-	-	2 890 000	2 445 333.91	0.57
Grupo Bimbo	3.875	27.06.24	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	980 577.21	0.23
Hpcl-Mittal 5.25% 17-28.04.27	5.250	28.04.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Hunt 6.375% 18-01.06.28 /Pool Regs	6.375	01.06.28	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 201 200.00	0.28
Informa 2.125% 20-06.10.25	2.125	06.10.25	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	1 041 015.84	0.24

JSS Sustainable Bond - Total Return Global (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Intl Bk Rec 4.25% 21-22.01.26	4.250	22.01.26	RUB	200 000 000	-	-200 000 000	-	-	0.00
Intl Bk Rec 5.0% 21-22.01.26	5.000	22.01.26	BRL	15 000 000	-	-	15 000 000	2 839 398.83	0.66
Intl Bk Rec 5.75% 21-14.01.28	5.750	14.01.28	BRL	-	7 000 000	-	7 000 000	1 266 791.97	0.29
Intl Bk Rec 9.50% 22-09.02.29	9.500	09.02.29	BRL	-	12 500 000	-	12 500 000	2 591 212.50	0.60
Intl Fin 6.5% 19-27.03.26	6.500	27.03.26	BRL	15 000 000	-	-	15 000 000	2 913 559.34	0.68
Intl Fin 6.75% 19-27.08.24	6.750	27.08.24	BRL	20 000 000	-	-15 000 000	5 000 000	999 415.11	0.23
Intl Fin 7% 17-20.07.27	7.000	20.07.27	MXN	99 000 000	-	-	99 000 000	5 322 146.35	1.23
Intl Fin 8.25% 18-30.01.23	8.250	30.01.23	BRL	10 000 000	-	-10 000 000	-	-	0.00
Jsw Hy 4.125% 18.05.31 /Pool Regs	4.125	18.05.31	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 418 929.58	0.33
Keppel Corp 2.459% 20-04.06.25	2.459	04.06.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 879 550.00	0.44
Lenovo Grp 5.875% 20-24.04.25	5.875	24.04.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	995 105.00	0.23
Mcdonalds	4.875	09.12.45	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Mdc 2.875% 19-07.11.29	2.875	07.11.29	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 809 024.00	0.42
Mdc 3% 17-19.04.24	3.000	19.04.24	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	977 868.00	0.23
Mexico	5.750	05.03.26	MXN	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Mexico 7.5% 06-03.06.27 Bonos	7.500	03.06.27	MXN	800 000	-	-380 000	420 000	2 331 102.20	0.54
Mexico 7.75% 11-29.05.31 Bonos	7.750	29.05.31	MXN	-	490 000	-	490 000	2 703 876.92	0.63
Millicom Ic 5.125% 17-15.01.28	5.125	15.01.28	USD	1 200 000	-	-	1 200 000	946 092.96	0.22
Minejesa 4.625% 10.08.30 /Pool	4.625	10.08.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	900 207.76	0.21
Minerva Lux 4.375% 21-18.03.31	4.375	18.03.31	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Nat Fin 2.374% 21-Perp	2.374	31.12.99	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	1 925 080.41	0.45
Nbm Us Hold 7% 19-14.05.26 Regs	7.000	14.05.26	USD	4 000 000	-	-	4 000 000	3 882 760.16	0.90
Network I2l 5.65% 19-Perp	5.650	31.12.99	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 460 625.00	0.34
Nomura Hldg 1.653% 21-14.07.26	1.653	14.07.26	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Nomura Hldg 2.172% 21-14.07.28	2.172	14.07.28	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 265 824.64	0.29
Norway 1.5% 16-19.02.26	1.500	19.02.26	NOK	-	40 000 000	-20 000 000	20 000 000	1 751 049.07	0.41
Norwegian G 1.25% 21-17.09.31	1.250	17.09.31	NOK	80 000 000	15 000 000	-	95 000 000	7 363 937.96	1.71
Norwegian G 1.375% 20-19.08.30	1.375	19.08.30	NOK	100 000 000	22 000 000	-40 000 000	82 000 000	6 553 552.09	1.52
Norwegian G 1.75% 19-06.09.29	1.750	06.09.29	NOK	-	20 000 000	-	20 000 000	1 665 549.63	0.39
Oracle Corp	4.000	15.07.46	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	1 914 105.60	0.44
Parkway Pan 4.25% 17-Perp	4.250	31.12.99	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Poland	2.500	25.07.26	PLN	15 000 000	-	-15 000 000	-	-	0.00
Poland 1.25% 19-25.10.30	1.250	25.10.30	PLN	20 000 000	21 000 000	-10 000 000	31 000 000	5 691 475.21	1.32
Poland 1.75% 21-25.04.32	1.750	25.04.32	PLN	21 000 000	31 000 000	-27 000 000	25 000 000	4 493 048.39	1.04
Poland 2.5% 16-25.07.27	2.500	25.07.27	PLN	40 000 000	-	-40 000 000	-	-	0.00
Qatar 3.40% 20-16.04.25 Regs	3.400	16.04.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	972 589.00	0.23
Qatar Reins 4.95% 17-Perp Regs	4.950	31.12.99	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Qtel Int Fi	3.250	21.02.23	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Raizn Fuel 5.3% 17-20.01.27 Regs	5.300	20.01.27	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	977 684.40	0.23
San M / Ng 3.50% 21-02.08.28	3.500	02.08.28	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 701 000.88	0.39
Sappi Papie 3.125% 19-15.04.26	3.125	15.04.26	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Sappi Papier H 3.625% 15.03.28	3.625	15.03.28	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	960 789.15	0.22
Sig Combibl 2.125% 20-18.06.25	2.125	18.06.25	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 581 554.51	0.37
Sigma	4.125	02.05.26	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 909 007.82	0.44
Silgan Hldg 3.25% 17-15.03.25	3.250	15.03.25	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	2 143 300.64	0.50
Singapore	2.125	01.06.26	SGD	14 000 000	-	-14 000 000	-	-	0.00
Singapore 1.625% 21-01.07.31	1.625	01.07.31	SGD	35 000 000	-	-	35 000 000	23 236 777.88	5.39
Singapore 2.375% 15-01.06.25	2.375	01.06.25	SGD	5 000 000	-	-5 000 000	-	-	0.00
Softbank 2.875% 21-06.01.27	2.875	06.01.27	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	1 928 342.50	0.45
Solvay 2.50% 20-Perp Regs	2.500	31.12.99	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	2 011 422.15	0.47
Swiss I 9.85% 16.07.32 /Pool Regs	9.850	16.07.32	BRL	-	12 000 000	-	12 000 000	1 913 568.85	0.44
Targa Res 6.875% 19-15.01.29	6.875	15.01.29	USD	500 000	-	-	500 000	507 063.30	0.12
Tcom It Cap	7.200	18.07.36	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Telefonica	5.875	31.12.99	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 644 232.46	0.38
Telefonica 2.88% 21-Perp	2.880	31.12.99	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 380 507.21	0.32
Tenc Hol 3.595% 18-19.01.28 Regs	3.595	19.01.28	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
The Kraft 4.375% 16-01.06.46	4.375	01.06.46	USD	2 000 000	-	-500 000	1 500 000	1 273 536.68	0.30
T-Mobile Us 2.25% 21-15.02.26	2.250	15.02.26	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	919 802.80	0.21
T-Mobile Us 2.625% 21-15.02.29	2.625	15.02.29	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 608 313.70	0.61

JSS Sustainable Bond - Total Return Global (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Uk T Bill 0.25% 20-31.07.31	0.250	31.07.31	GBP	-	12 000 000	-	12 000 000	11 017 264.83	2.56
Usa 0.50% 20-30.06.27 /Tbo	0.500	30.06.27	USD	16 000 000	5 000 000	-6 000 000	15 000 000	12 932 519.55	3.00
Usa 0.875% 20-15.11.30 /Tbo	0.875	15.11.30	USD	12 000 000	13 000 000	-5 000 000	20 000 000	16 180 468.80	3.75
Usa 1.125% 20-15.05.40 /Tbo	1.125	15.05.40	USD	28 100 000	-	-8 100 000	20 000 000	12 956 250.00	3.01
Usa 1.25% 21-30.06.28 /Tbo	1.250	30.06.28	USD	10 000 000	15 000 000	-	25 000 000	21 758 789.00	5.05
Usa 1.625% 19-30.11.26 /Tbo	1.625	30.11.26	USD	12 500 000	1 000 000	-2 000 000	11 500 000	10 498 916.03	2.44
Usa 1.75% 19-15.11.29 /Tbo	1.750	15.11.29	USD	-	17 500 000	-	17 500 000	15 343 945.40	3.56
Usa 2.375% 22-15.02.42 /Tbo	2.375	15.02.42	USD	3 200 000	9 800 000	-	13 000 000	10 109 023.47	2.35
Usa 3.125% 22-15.08.25 /Tbo	3.125	15.08.25	USD	-	8 000 000	-3 000 000	5 000 000	4 829 394.55	1.12
Vmware Inc 3.9% 17-21.08.27	3.900	21.08.27	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	948 480.61	0.22
Vmware Inc 4.70% 20-15.05.30	4.700	15.05.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	955 839.26	0.22
Western Dig 4.75% 18-15.02.26	4.750	15.02.26	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	952 932.10	0.22
								366 374 982.24	85.03

Indexoptionen

10Y Treasury Notes Usa		24.02.23	USD	-	130	-130	-	-	0.00
10Y Treasury Notes Usa		24.02.23	USD	-	100	-100	-	-	0.00
10Y Treasury Notes Usa		24.03.23	USD	-	100	-100	-	-	0.00
5Y Treasury Notes Usa		23.09.22	USD	-	100	-100	-	-	0.00
									0.00

Schatzwechsel

Usa 0% 22-29.06.23 Tb		29.06.23	USD	-	10 000 000	-10 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-20.06.23 Tb		20.06.23	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-27.07.23 Tb		27.07.23	USD	-	10 000 000	-	10 000 000	9 966 583.30	2.31
								9 966 583.30	2.31

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

376 341 565.54 87.34

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Allstate	5.750	15.08.53	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 955 958.02	0.69
Amaggi Lux 5.25% 21-28.01.28	5.250	28.01.28	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Az 3.575% 21-19.08.26 /Pool	3.575	19.08.26	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Bpcm 4.375% 20-Perp	4.375	31.12.99	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	961 750.00	0.22
Chen Eng 4.50% 20-01.10.29	4.500	01.10.29	USD	3 500 000	-	-	3 500 000	3 214 668.80	0.75
Clearway 4.75% 19-15.03.28 144A	4.750	15.03.28	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	923 616.80	0.21
Cosan Lux 7% 16-20.01.27	7.000	20.01.27	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	2 004 014.00	0.46
Count Gard 3.125% 20-22.10.25	3.125	22.10.25	USD	3 000 000	-	-2 000 000	1 000 000	315 150.00	0.07
Dcp Mid Op 5.125% 19-15.05.29	5.125	15.05.29	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 958 157.00	0.45
Enlink Midst 6.50% 01.09.30 Regs	6.500	01.09.30	USD	-	500 000	-	500 000	498 909.50	0.12
Entel 3.05% 21-14.09.32 /Pool	3.050	14.09.32	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 585 700.00	0.37
Eqst Mdstm 4.50% 21-15.01.29	4.500	15.01.29	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 339 295.25	0.31
Flex Ltd 3.75% 20-01.02.26	3.750	01.02.26	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	950 604.54	0.22
Hess Midstr 5.125% 19-15.06.28	5.125	15.06.28	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	936 835.86	0.22
Mexico Cete 7.50% 22-26.05.33	7.500	26.05.33	MXN	-	580 000	-	580 000	3 116 080.59	0.72
Poland 0.25% 20-25.10.26	0.250	25.10.26	PLN	20 000 000	-	-20 000 000	-	-	0.00
Rural Elec 2.75% 21-13.01.27	2.750	13.01.27	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 798 219.78	0.42
Sd Hi-Sp Gr 2.437% 20-19.11.23	2.437	19.11.23	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 956 875.00	0.69
Seagate Hdd 3.125% 20-15.07.29	3.125	15.07.29	USD	4 000 000	-	-4 000 000	-	-	0.00
Seagate Hdd 9.625% 22-01.12.32	9.625	01.12.32	USD	-	3 120 000	-	3 120 000	3 444 919.92	0.80
Shriram 4.15% 22-18.07.25 Regs	4.150	18.07.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	946 179.82	0.22
Sino-Ocean 3.25% 21-05.05.26	3.250	05.05.26	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Targa Res Par 4% 22-15.01.32	4.000	15.01.32	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 297 985.48	0.30
Targa Res Par 6.5% 19-15.07.27	6.500	15.07.27	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 490 567.85	0.35
Temasek Fin 2.25% 20-06.04.51	2.250	06.04.51	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Transm 5.20% 11.04.38 /Pool	5.200	11.04.38	USD	1 300 000	-	-	1 300 000	1 208 239.11	0.28

JSS Sustainable Bond - Total Return Global (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Western Gas 3.10% 20-01.02.25	3.100	01.02.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	956 775.30	0.22
Western Gas 4.05% 20-01.02.30	4.050	01.02.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	899 959.00	0.21
Xiaomi Best 3.375% 20-29.04.30	3.375	29.04.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	813 029.12	0.19
								36 573 490.74	8.49
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								36 573 490.74	8.49
SUMME WERTPAPIERBESTAND								412 915 056.28	95.83
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								12 349 644.42	2.87
Sonstige Aktiven								5 621 354.73	1.30
GESAMTNETTOVERMÖGEN								430 886 055.43	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Activision Blizzard Inc			USD	-	20 222	-495	19 727	1 662 986.10	3.09
Adobe Systems			USD	587	225	-812	-	-	0.00
Adyen B.V. 144A			EUR	171	526	-697	-	-	0.00
Align Technology Inc			USD	333	215	-548	-	-	0.00
Alphabet Inc -A-			USD	426	17 163	-5 102	12 487	1 494 693.90	2.78
Amazon Com Inc			USD	6 042	19 195	-3 245	21 992	2 866 877.12	5.33
Basic-Fit N.V.			EUR	4 514	17 115	-5 014	16 615	634 443.78	1.18
Booking Holdings Inc			USD	-	463	-1	462	1 247 552.46	2.32
Chipotle Mexican Grill Inc			USD	590	905	-437	1 058	2 263 062.00	4.20
Cie Financiere Richemont Nam-Ak			CHF	5 354	13 757	-3 825	15 286	2 591 094.66	4.81
Cts Eventim Akt.			EUR	3 668	16 235	-1 166	18 737	1 182 573.58	2.20
Dav Cam Mil Rg			EUR	50 507	47 699	-73 141	25 065	347 019.66	0.64
Deckers Outdoor Corp.			USD	-	1 496	-17	1 479	780 409.14	1.45
Dsm-Firmenich Ltd			EUR	-	9 292	-	9 292	999 767.35	1.86
Electronic Arts			USD	2 141	13 349	-1 499	13 991	1 814 632.70	3.37
Essilor International			EUR	3 604	5 239	-2 050	6 793	1 279 166.73	2.38
Estee Lauder Co -A-			USD	390	25	-415	-	-	0.00
Facebook Inc -A-			USD	1 125	66	-1 191	-	-	0.00
Ferrari N.V.			EUR	-	4 840	-470	4 370	1 427 917.17	2.65
Haleon Rg			GBP	-	424 792	-200 761	224 031	917 838.29	1.70
Hermes International			EUR	303	804	-356	751	1 630 488.59	3.03
Infineon Technologies /Nam.			EUR	8 092	38 244	-13 238	33 098	1 364 413.25	2.53
Intercontinental Hotels Group Plc			GBP	4 850	24 142	-8 741	20 251	1 399 043.55	2.60
Kerry Group A			EUR	1 725	531	-2 256	-	-	0.00
Koninklijke Dsm Nv			EUR	-	6 981	-6 981	-	-	0.00
L Occitane International Sa			HKD	131 501	260 067	-65 488	326 080	783 927.96	1.46
L Oreal			EUR	1 520	2 745	-860	3 405	1 586 614.57	2.95
Leroy Seafood Group Asa			NOK	-	38 913	-38 913	-	-	0.00
Lilly (Eli) & Co			USD	-	3 006	-428	2 578	1 209 030.44	2.25
Live Nation Entertainment Inc			USD	2 739	8 032	-10 771	-	-	0.00
Lvmh Act.			EUR	1 304	2 976	-631	3 649	3 435 653.92	6.38
Mastercard Inc. Shs-A-			USD	797	4 246	-159	4 884	1 920 877.20	3.57
Mercadolibre Inc			USD	-	1 482	-673	809	958 341.40	1.78
Microsoft Corp			USD	3 444	7 087	-4 497	6 034	2 054 818.36	3.82
Mips Ab			SEK	-	5 534	-55	5 479	270 973.64	0.50
Mowi Asa			NOK	-	11 439	-11 439	-	-	0.00
Nestle / Act Nom			CHF	4 489	14 667	-6 839	12 317	1 481 372.31	2.75
New York Times A			USD	5 914	1 986	-7 900	-	-	0.00
Nike Inc B			USD	4 133	11 972	-5 121	10 984	1 212 304.08	2.25
Novo Nordisk A/S /-B-			DKK	3 558	1 014	-4 572	-	-	0.00
Nvidia Corp.			USD	2 276	5 137	-4 365	3 048	1 289 364.96	2.40
On Semiconductor Corp			USD	11 858	15 919	-20 200	7 577	716 632.66	1.33
Pernod-Ricard			EUR	2 623	5 790	-2 939	5 474	1 208 759.92	2.25
Planet Fitness Inc			USD	10 265	16 662	-5 009	21 918	1 478 149.92	2.75
Prada – Registered Shs			HKD	79 442	126 816	-39 970	166 288	1 114 015.69	2.07
Puma Se			EUR	3 303	12 358	-1 675	13 986	841 060.98	1.56
Sensient Technologies Co			USD	3 188	7 036	-10 224	-	-	0.00
Shimano Inc.			JPY	1 214	4 380	-1 270	4 324	716 802.50	1.33
Tencent Holdings Ltd			HKD	-	22 943	-143	22 800	964 762.61	1.79
The Trade Desk Inc			USD	-	13 885	-484	13 401	1 034 825.22	1.92

JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Univ Mu Gr Br Rg			EUR	29 877	56 656	-44 680	41 853	929 214.03	1.73
Yeti Holdings Inc			USD	1 688	102	-1 790	-	-	0.00
								51 111 482.40	94.96
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								51 111 482.40	94.96
SUMME WERTPAPIERBESTAND								51 111 482.40	94.96
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								2 763 227.44	5.13
Sonstige Passiven								-52 051.83	-0.09
GESAMTNETTOVERMÖGEN								53 822 658.01	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

Adobe Systems			USD	-	8 484	-	8 484	4 148 591.16	1.62
Advanced Micro Devices Inc			USD	13 185	25 364	-4 632	33 917	3 863 485.47	1.51
Alphabet Inc -A-			USD	9 007	188 176	-106 797	90 386	10 819 204.20	4.22
Altium			AUD	112 467	27 093	-	139 560	3 429 798.37	1.34
Amazon Com Inc			USD	41 440	33 863	-	75 303	9 816 499.08	3.83
American Tower Corp			USD	13 894	-	-	13 894	2 694 602.36	1.05
Analog Devices Inc			USD	111 803	-	-59 795	52 008	10 131 678.48	3.95
Apple Inc			USD	42 286	18 876	-32 125	29 037	5 632 306.89	2.20
Applied Materials Inc			USD	109 740	-	-33 278	76 462	11 051 817.48	4.31
Ciena Corp			USD	34 954	-	-34 954	-	-	0.00
Coherent Rg			USD	-	210 795	-141 366	69 429	3 539 490.42	1.38
Dexcom Inc			USD	20 292	-	-20 292	-	-	0.00
Elastic B.V.			USD	99 482	35 693	-99 482	35 693	2 288 635.16	0.89
Entegris Inc			USD	22 245	-	-22 245	-	-	0.00
Equinix Inc /Reit			USD	8 942	-	-8 942	-	-	0.00
Facebook Inc -A-			USD	34 460	19 690	-35 553	18 597	5 336 967.06	2.08
Fisimith & Co. A/S B			DKK	267 466	-	-106 228	161 238	7 800 999.92	3.05
Global Payments Inc			USD	76 081	9 642	-85 723	-	-	0.00
Godaddy Inc			USD	64 148	32 122	-96 270	-	-	0.00
li-Vi Inc			USD	193 992	16 803	-210 795	-	-	0.00
Intel Corp.			USD	246 573	184 984	-149 885	281 672	9 419 111.68	3.68
Jd.Com Rg-A			HKD	7 376	-	-7 376	-	-	0.00
Keysight Technologies Inc			USD	30 408	12 910	-5 204	38 114	6 382 189.30	2.49
Kion Group / Eq Usd			EUR	81 653	-	-22 250	59 403	2 388 847.69	0.93
Lundin Mining Corp			CAD	396 772	-	-150 610	246 162	1 930 973.92	0.75
Match Group Rg			USD	28 250	-	-28 250	-	-	0.00
Meituan			HKD	-	13 669	-13 669	-	-	0.00
Micron Technology Inc			USD	49 399	79 944	-50 350	78 993	4 985 248.23	1.95
Microsoft Corp			USD	101 935	28 068	-73 862	56 141	19 118 256.14	7.46
Nokia Oy			EUR	1 131 727	-	-358 096	773 631	3 237 282.51	1.26
Nvidia Corp.			USD	69 354	2 050	-39 920	31 484	13 318 361.68	5.20
On Semiconductor Corp			USD	32 988	-	-32 988	-	-	0.00
Onto Innovation			USD	107 889	18 702	-17 784	108 807	12 672 751.29	4.95
Outotec Oyj			EUR	1 328 240	-	-705 581	622 659	7 503 100.11	2.93
Palo Alto Networks Inc			USD	-	44 181	-	44 181	11 288 687.31	4.41
Rapid7 Inc			USD	76 295	-	-76 295	-	-	0.00
Rohm Co.Ltd			JPY	88 417	14 200	-26 122	76 495	7 155 446.70	2.79
Salesforce Com Inc			USD	30 431	30 523	-21 899	39 055	8 250 759.30	3.22
Samsung El./Sp.Gdr (1/2Vot144A)			USD	3 356	-	-1 127	2 229	3 089 394.00	1.21
Servicenow Inc			USD	28 814	4 841	-10 462	23 193	13 033 770.21	5.09
Stmicroelectronics Nv			EUR	197 371	19 631	-98 597	118 405	5 886 080.10	2.30
Synopsys Inc.			USD	48 236	-	-8 522	39 714	17 291 872.74	6.75
Tencent Holdings Ltd			HKD	189 523	57 600	-92 227	154 896	6 554 292.52	2.56
The Trade Desk Inc			USD	84 420	76 538	-83 566	77 392	5 976 210.24	2.33
Tokyo Electron Co Ltd			JPY	36 946	36 858	-27 519	46 285	6 584 008.59	2.57
Twilio Inc -A-			USD	10 765	-	-10 765	-	-	0.00
Ubisoft Entertainment			EUR	99 751	-	-65 207	34 544	975 352.60	0.38

JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Walt Disney Company			USD	-	51 952	-	51 952	4 638 274.56	1.81
Zscaler Inc			USD	47 057	53 112	-77 564	22 605	3 307 111.50	1.29
							255 541 458.97	99.74	
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								255 541 458.97	99.74
SUMME WERTPAPIERBESTAND								255 541 458.97	99.74
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								850 618.91	0.33
Sonstige Passiven								-189 510.94	-0.07
GESAMTNETTOVERMÖGEN								256 202 566.94	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Anleihen

Argentina 15.5% 16-17.10.26	15.500	17.10.26	ARS	241 500 000	-	-	241 500 000	198 681.99	0.68
Argentina 16% 16-17.10.23	16.000	17.10.23	ARS	35 100 000	-	-	35 100 000	111 805.88	0.38
Brazil 4.25% 13-07.01.25	4.250	07.01.25	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Brazil 6.0% 23-20.10.33	6.000	20.10.33	USD	-	1 000 000	-500 000	500 000	495 115.28	1.69
Chile 4.7% 18-01.09.30	4.700	01.09.30	CLP	900 000 000	-	-	900 000 000	1 087 025.19	3.70
China Dv Bk 4.3% 12-02.08.32	4.300	02.08.32	CNH	10 000 000	-	-10 000 000	-	-	0.00
Colombia 8.125% 04-21.05.24	8.125	21.05.24	USD	-	400 000	-	400 000	408 402.00	1.39
Colombia 9.85% 07-27 /Int.Usd	9.850	28.06.27	COP	4 600 000 000	-	-	4 600 000 000	1 061 939.18	3.61
Czech Rep 2% 17-13.10.33	2.000	13.10.33	CZK	26 000 000	-	-	26 000 000	967 827.37	3.29
Ebrd 4.95% 21-22.01.26	4.950	22.01.26	INR	-	50 000 000	-	50 000 000	580 247.05	1.97
Egypt 8.875% 20-29.05.50 Regs	8.875	29.05.50	USD	900 000	-	-400 000	500 000	270 835.00	0.92
Eib 2.60% 22-29.09.26	2.600	29.09.26	CNH	-	7 000 000	-	7 000 000	970 213.48	3.30
Emp 8.375% 17-08.11.27 Regs	8.375	08.11.27	COP	3 000 000 000	-	-	3 000 000 000	576 621.23	1.96
Far East Ho 4.70% 21-09.02.24	4.700	09.02.24	CNH	9 000 000	-	-	9 000 000	1 203 814.60	4.10
Hungary 4.0% 21-28.04.51	4.000	28.04.51	HUF	-	200 000 000	-	200 000 000	375 268.52	1.28
Hungary 5.75% 13-22.11.23	5.750	22.11.23	USD	-	500 000	-	500 000	500 201.50	1.70
Hungary Gov 3.0% 20-25.04.41	3.000	25.04.41	HUF	200 000 000	-	-200 000 000	-	-	0.00
Ibrd 0% 15-29.05.35	0.000	29.05.35	ZAR	-	30 000 000	-	30 000 000	489 595.82	1.67
Indonesia 8.25% 11-15.06.32	8.250	15.06.32	IDR	18 000 000 000	-	-18 000 000 000	-	-	0.00
Indonesia 8.375% 18-15.04.39	8.375	15.04.39	IDR	15 000 000 000	-	-	15 000 000 000	1 168 397.31	3.98
Intl Bk Rec 2.25% 22-19.01.29	2.250	19.01.29	CNH	-	5 000 000	-	5 000 000	682 493.87	2.32
Intl Bk Rec 6.25% 23-19.01.29	6.250	19.01.29	IDR	-	15 000 000 000	-	15 000 000 000	1 018 759.13	3.47
Intl Fin 0% 18-22.02.38	0.000	22.02.38	MXN	-	40 000 000	-	40 000 000	676 711.04	2.30
Mexico 8% 17-07.11.47	8.000	07.11.47	MXN	-	60 000	-	60 000	319 895.52	1.09
Mexico 8.5% 08-18.11.38	8.500	18.11.38	MXN	320 000	-	-320 000	-	-	0.00
Mexico 8.5% 09-31.05.29 Bonos	8.500	31.05.29	MXN	50 000	-	-50 000	-	-	0.00
Morocco 4.25 % 12-11.12.22	4.250	11.12.22	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Peru 3.23% 20-28.07.21	3.230	28.07.21	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Peru 5.35% 19-12.08.40	5.350	12.08.40	PEN	-	2 500 000	-	2 500 000	574 469.60	1.96
Peru 6.95% 08-12.08.31	6.950	12.08.31	PEN	3 500 000	-	-3 500 000	-	-	0.00
Philippines 3.9% 12-26.11.22	3.900	26.11.22	PHP	10 000 000	-	-10 000 000	-	-	0.00
Poland 1.25% 19-25.10.30	1.250	25.10.30	PLN	5 000 000	-	-5 000 000	-	-	0.00
Poland 1.75% 21-25.04.32	1.750	25.04.32	PLN	3 500 000	-	-	3 500 000	629 026.77	2.14
Qnb Fin 6.90% 20-23.01.25	6.900	23.01.25	IDR	4 000 000 000	-	-	4 000 000 000	265 199.20	0.90
Romania 1% 21-14.04.33	1.000	14.04.33	EUR	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Romania 2.75% 21-14.04.41	2.750	14.04.41	EUR	-	900 000	-	900 000	604 553.38	2.06
Russia 7.05% 13-19.01.28**	7.050	19.01.28	RUB	70 000 000	-	-	70 000 000	-	0.00
Russia 8.15% 12-03.02.27 S 26207**	8.150	03.02.27	RUB	115 000 000	-	-	115 000 000	-	0.00
Simpar Fin 10.75% 12.02.28 Regs	10.750	12.02.28	BRL	6 000 000	-	-	6 000 000	985 697.24	3.35
South Afr 8.5% 13-31.01.37	8.500	31.01.37	ZAR	27 000 000	-	-	27 000 000	1 093 158.04	3.72
South Afr 8.75% 14-31.01.44	8.750	31.01.44	ZAR	37 000 000	-	-	37 000 000	1 437 902.52	4.89
South Africa 4.665% 12-17.01.24	4.665	17.01.24	USD	500 000	-	-	500 000	495 750.00	1.69
South Africa 6.5% 10-28.02.41	6.500	28.02.41	ZAR	17 000 000	13 000 000	-	30 000 000	941 316.64	3.20
Swiss I 9.85% 16.07.32 /Pool Regs	9.850	16.07.32	BRL	3 000 000	-	-	3 000 000	478 392.21	1.63
Thailand Gov 3.775% 12-26.06.32	3.775	25.06.32	THB	20 000 000	-	-20 000 000	-	-	0.00
							20 669 316.56	70.34	

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

20 669 316.56 70.34

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Brazil 10% 14-01.01.25	10.000	01.01.25	BRL	5 000	-	-5 000	-	-	0.00
Brazil 10% 20-01.01.31	10.000	01.01.31	BRL	2 800	3 200	-	6 000	1 210 048.43	4.12

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Columbia 4.375% 21.03.23	4.375	21.03.23	COP	1 800 000 000	-	-1 800 000 000	-	-	0.00
Dominican R 9.75% 19-05.06.26 Regs	9.750	05.06.26	DOP	50 000 000	-	-30 000 000	20 000 000	370 663.84	1.26
Ebrd 4.60% 20-09.12.25	4.600	09.12.25	IDR	17 500 000 000	-	-	17 500 000 000	1 136 376.24	3.87
Malaysia 2.632% 20-15.04.31	2.632	15.04.31	MYR	6 000 000	-	-	6 000 000	1 178 829.38	4.01
Malaysia 3.955% 15-15.09.25	3.955	15.09.25	MYR	5 000 000	-	-5 000 000	-	-	0.00
Malaysia 4.065% 20-15.06.50	4.065	15.06.50	MYR	-	3 000 000	-	3 000 000	626 627.23	2.13
Mexico Cete 8% 22-31.07.53	8.000	31.07.53	MXN	-	240 000	-100 000	140 000	740 823.09	2.52
Min Fin Ruf 6.9% 18-23.05.29**	6.900	23.05.29	RUB	70 000 000	-	-	70 000 000	-	0.00
Min Fin Ruf 7.70% 19-16.03.39**	7.700	16.03.39	RUB	75 000 000	-	-	75 000 000	-	0.00
Min Of Fin 2.875% 16-17.06.46	2.875	17.06.46	THB	20 000 000	-	-	20 000 000	534 866.43	1.82
								5 798 234.64	19.73
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								5 798 234.64	19.73
Sonstige übertragbare Wertpapiere									
Anleihen									
Malaysia 4.369% 18-31.10.28	4.369	31.10.28	MYR	8 100 000	-	-6 100 000	2 000 000	442 436.59	1.51
Rabobk Ny 0.50% 14-26.02.29	0.500	26.02.29	HUF	200 000 000	-	-	200 000 000	359 181.40	1.22
								801 617.99	2.73
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere								801 617.99	2.73
SUMME WERTPAPIERBESTAND								27 269 169.19	92.80
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								1 390 174.54	4.73
Sonstige Aktiven								725 595.00	2.47
GESAMTNETTOVERMÖGEN								29 384 938.73	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

** Siehe Erläuterung 17

JSS Equity - All China

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2023

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

3Peak Incorp Rg-A			CNH	-	36 361	-36 361	-	-	0.00
Accelink Technologies Co -A-			CNH	-	510 369	-	510 369	2 605 930.91	0.89
Alibaba Group Holding Ltd			HKD	1 407 300	1 811 700	-2 510 500	708 500	7 341 198.70	2.49
Anhui Gujing Distillery Co Ltd			CNH	-	148 290	-124 100	24 190	823 800.84	0.28
Anhui Kouzi Distillery Co Ltd			CNH	-	451 786	-	451 786	3 069 316.72	1.04
Anta Sports Products Ltd			HKD	166 200	-	-166 200	-	-	0.00
Baidu Inc -A-/Adr			USD	-	8 596	-	8 596	1 176 878.36	0.40
Baidu Rg-A			HKD	-	156 950	-	156 950	2 659 686.75	0.90
Bank Of Ningbo Co Ltd			CNH	1 514 547	1 959 380	-2 786 000	687 927	2 395 988.10	0.81
Beij Or Ywt			CNH	1 652 562	1 534 000	-2 790 662	395 900	1 485 706.89	0.51
Bilibili-Z Rg			HKD	-	253 200	-253 200	-	-	0.00
Bj Chuntiz /H			HKD	757 750	435 250	-	1 193 000	2 313 956.16	0.79
Bj Kingsoft Rg-A			CNH	-	21 850	-	21 850	1 420 422.68	0.48
Boe Varitronix Ltd			HKD	-	617 000	-617 000	-	-	0.00
China Cosco Holdings -H-			HKD	3 997 500	9 959 500	-11 069 000	2 888 000	2 601 794.46	0.88
China Cssc Holdings Ltd			CNH	-	1 876 230	-231 500	1 644 730	7 451 509.83	2.53
China Int Travel Serv Corp			CNH	144 500	114 700	-259 200	-	-	0.00
China Lesso Group Holdings Ltd			HKD	5 975 000	-	-5 975 000	-	-	0.00
China Merchants Bank Co -A-			CNH	3 526 210	850 637	-2 194 700	2 182 147	9 841 236.73	3.34
China Molybdenum Co Ltd			CNH	-	4 179 000	-4 179 000	-	-	0.00
China Oilfield Services Ltd			CNH	-	2 294 367	-2 294 367	-	-	0.00
China Overseas Land+Investment			HKD	1 984 500	-	-1 984 500	-	-	0.00
China Pacific Insur -A-			CNH	-	498 500	-	498 500	1 782 896.30	0.61
China Railway Group Ltd			CNH	-	3 963 600	-3 963 600	-	-	0.00
China Shenhua Energy Co -H-			HKD	2 209 000	608 500	-2 817 500	-	-	0.00
China State Constr Engineer-A-			CNH	21 750 091	2 810 680	-17 730 400	6 830 371	5 397 317.30	1.83
China Tourism /H			HKD	-	38 600	-38 600	-	-	0.00
China Yangtze Power Co Ltd -A-			CNH	3 715 100	657 500	-4 372 600	-	-	0.00
Chinasoft International			HKD	3 526 000	-	-3 526 000	-	-	0.00
Chongqing Brewery Co Ltd			CNH	-	411 186	-411 186	-	-	0.00
Cn Universe			CNH	-	315 400	-315 400	-	-	0.00
Contemp			CNH	203 281	233 724	-	437 005	13 764 017.74	4.67
Cosco Ship Registered Shs -A-			CNH	-	380 100	-380 100	-	-	0.00
Cspc Pharmaceut – Shs			HKD	-	5 840 000	-5 840 000	-	-	0.00
Dada Nexus/ Sadr			USD	-	1 307 854	-977 455	330 399	1 754 418.69	0.60
East Money Information Co -A-			CNH	1 690 580	1 808 760	-1 690 580	1 808 760	3 535 827.50	1.20
Gcl New Energy Holdings Ltd			HKD	-	4 612 908	-4 612 908	-	-	0.00
Gcl Tech – Registered Shs			HKD	9 852 000	4 654 000	-14 506 000	-	-	0.00
Gd Power Development Co Ltd			CNH	-	6 758 600	-6 758 600	-	-	0.00
Gigadevice-A-			CNH	151 416	-	-151 416	-	-	0.00
Greentown Mgmt Rg			HKD	-	4 033 000	-1 298 000	2 735 000	2 170 794.99	0.74
Guangzhou Auto -H-			HKD	5 850 000	-	-5 850 000	-	-	0.00
Guodian Nari Technology Co -A-			CNH	1 762 560	-	-1 762 560	-	-	0.00
H.K.Exchanges And Clearing Ltd			HKD	217 500	125 000	-217 500	125 000	4 708 661.40	1.60
Haier Smart			CNH	1 065 879	478 600	-1 544 479	-	-	0.00
Henan Shenhua Coal Ind.-A-			CNH	-	2 157 800	-2 157 800	-	-	0.00
Hygeia Healthc Rg			HKD	-	277 400	-277 400	-	-	0.00
Icbc -A-			CNH	-	7 325 193	-	7 325 193	4 860 578.10	1.65
Jd.Com Rg-A			HKD	393 319	57 150	-450 469	-	-	0.00
Jiangsu Hendrui Medicine Co-A-			CNH	-	1 068 380	-294 000	774 380	5 106 359.90	1.73
Js Zhong			CNH	-	713 200	-713 200	-	-	0.00
Jsu Yanghe			CNH	-	293 319	-142 000	151 319	2 736 184.13	0.93
Kanzhun Limited /Sadr			USD	-	310 973	-310 973	-	-	0.00
Keymed Biosci Rg			HKD	-	55 500	-55 500	-	-	0.00

JSS Equity - All China (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Kingsemi Rg-A			CNH	-	74 217	-	74 217	1 746 603.32	0.59
Kweichow Moutai Co Ltd -A-			CNH	153 656	32 700	-88 700	97 656	22 733 396.09	7.72
Lepu Med /Gdr			USD	-	552 000	-552 000	-	-	0.00
Lepu Medical Tech -A-			CNH	2 140 336	2 955 000	-2 580 100	2 515 236	7 828 906.14	2.66
Li Ning Company Ltd			HKD	-	242 500	-242 500	-	-	0.00
Longi Green			CNH	2 234 996	-	-2 234 996	-	-	0.00
Luzhou Old Cellar Co Ltd-A-			CNH	141 500	152 400	-141 500	152 400	4 396 791.39	1.49
Maxscend-A Rg			CNH	148 643	-	-148 643	-	-	0.00
Meituan Dianping			HKD	-	1 322 400	-992 200	330 200	5 153 171.80	1.75
Midea Group Co Ltd -A-			CNH	668 000	606 300	-668 000	606 300	4 917 813.89	1.67
Naura Technology Group Co Ltd			CNH	223 071	185 500	-241 871	166 700	7 289 642.65	2.48
Netease Rg			HKD	299 100	834 700	-789 300	344 500	6 708 336.74	2.28
Nx Baofeng Ene-A Rg			CNH	2 276 100	-	-2 276 100	-	-	0.00
Orient Cable -A-			CNH	523 700	-	-523 700	-	-	0.00
Orient Overseas (International)			HKD	247 000	-	-247 000	-	-	0.00
Pinduoduo Inc /Adr			USD	-	378 656	-89 815	288 841	19 970 466.74	6.78
Ping An Bank Co -A- Shs -A-			CNH	-	2 106 100	-1 480 300	625 800	967 469.05	0.33
Poly Develop-A Rg Registered Shs -A			CNH	-	1 343 216	-1 343 216	-	-	0.00
Poly Ppty Serv Rg-H			HKD	-	273 000	-273 000	-	-	0.00
Pony Testing Rg-A			CNH	-	576 502	-103 800	472 702	2 575 639.07	0.88
Power Const			CNH	3 858 714	-	-3 858 714	-	-	0.00
Rigol Techno Rg-A			CNH	-	312 819	-	312 819	2 595 039.85	0.88
Sands China /lpo			HKD	-	5 175 200	-5 175 200	-	-	0.00
Shanghai Aiko Rg-A			CNH	-	6 040 090	-	6 040 090	25 568 797.85	8.68
Shenzhen Fastpr-A-			CNH	-	1 279 050	-1 279 050	-	-	0.00
Simcere Pharma Rg			HKD	-	2 536 000	-2 536 000	-	-	0.00
South West Eco Development Ltd			HKD	-	1 630 000	-	1 630 000	3 694 040.57	1.25
Sungrow Power Supply Co Ltd			CNH	-	297 400	-79 400	218 000	3 500 165.24	1.19
Sunny Optical Technology			HKD	555 000	-	-555 000	-	-	0.00
Sz Mindray			CNH	297 354	11 400	-172 000	136 754	5 644 083.71	1.92
Sz S.C New Ene-A Rg			CNH	-	91 600	-91 600	-	-	0.00
Tangshan Port Group Co Ltd			CNH	-	457 300	-	457 300	222 227.42	0.08
Tcl Corporation			CNH	-	1 689 900	-1 689 900	-	-	0.00
Tencent Holdings Ltd			HKD	704 900	728 700	-794 600	639 000	27 038 741.59	9.18
Tjin Zh			CNH	5 659 779	3 950 081	-3 966 779	5 643 081	25 791 473.07	8.76
Tongdao Liepin Group			HKD	-	1 563 200	-1 563 200	-	-	0.00
Tongwei Co Ltd			CNH	956 700	699 291	-1 655 991	-	-	0.00
Trina Solar Rg-A			CNH	-	362 927	-362 927	-	-	0.00
Tsingtao Brewery Co Ltd -H-			HKD	-	804 000	-242 000	562 000	5 106 077.53	1.73
Wanhua Chemical Group Co -A-			CNH	-	173 400	-	173 400	2 096 829.89	0.71
Wh Huazhong Num -A-			CNH	-	284 136	-	284 136	2 093 457.51	0.71
Wuhu Sanqi			CNH	-	662 900	-662 900	-	-	0.00
Wuliangye Yibin Co Ltd -A-			CNH	1 090 454	347 711	-1 090 454	347 711	7 829 677.33	2.66
Wuxi Biologics Rg			HKD	-	326 000	-326 000	-	-	0.00
Xiamen Faratronic Co Ltd			CNH	-	105 183	-105 183	-	-	0.00
Xpeng Rg-A			HKD	-	291 900	-291 900	-	-	0.00
Yancoal Australia Shs			HKD	-	2 135 100	-2 135 100	-	-	0.00
Yanzhou Coal Mining Co -H-			HKD	-	1 366 000	-1 366 000	-	-	0.00
Yuexiu Services Rg			HKD	-	6 436 500	-6 436 500	-	-	0.00
Yunnan En			CNH	-	130 100	-130 100	-	-	0.00
Zhaojin Mining Ind.-H-			HKD	-	1 923 500	-909 500	1 014 000	1 265 458.49	0.43
Zhuzhou Hua Rg-A			CNH	-	105 879	-	105 879	1 220 721.03	0.42

JSS Equity - All China (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2022	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2023	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Zijin Mining Group Co Ltd			CNH	-	6 156 100	-2 318 100	3 838 000	6 007 409.40	2.04
Zijin Mining Group -H-			HKD	-	1 208 000	-1 208 000	-	-	0.00
							294 966 920.54	100.17	
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								294 966 920.54	100.17
SUMME WERTPAPIERBESTAND								294 966 920.54	100.17
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								16 891 213.50	5.74
Sonstige Passiven								-17 388 088.70	-5.91
GESAMTNETTOVERMÖGEN								294 470 045.34	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/
Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023

1. Gründung der Gesellschaft

JSS Investmentfonds (die „Gesellschaft“) ist eine offene Investmentgesellschaft (société d'investissement à capital variable - SICAV), die auf der Grundlage von Teil I des geänderten Gesetzes vom 17.12.2010 (das geänderte „Gesetz von 2010“) in der jeweils geltenden Fassung als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) gegründet wurde. Die Gesellschaft hat J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A., welche als Verwaltungsgesellschaft gemäß Kapitel 15 des Gesetzes von 2010 in seiner geänderten Fassung zugelassen ist, als ihre Verwaltungsgesellschaft ernannt.

Die Gesellschaft ist eine Anlagegesellschaft mit verschiedenen Teilfonds (Auflegungsdatum):

- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (30.09.2014)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets (05.06.1996)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Global Dividend (29.10.2010)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) (02.09.1992)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) (05.07.1995)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR) (31.03.2005)
- JSS Investmentfonds - JSS Twelve Sustainable Insurance Bond (31.10.2014)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Global Thematic (30.09.2005)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Global Short-term (31.07.2014)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond CHF (31.01.2001)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Euro Broad (06.01.2003)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (02.09.1992)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Europe (26.02.1993)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 (01.06.1999)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Real Estate Global (02.04.2007)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - USA (29.10.2010)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (16.02.1994)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Green Planet (27.12.2007)
- JSS Investmentfonds - JSS Bond - USD High Yield (30.03.2015)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Total Return Global (30.12.2015)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer (31.05.2018)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors (31.05.2018)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency (18.06.2019)
- JSS Investmentfonds - JSS Equity - All China (17.12.2019)

Die Gesellschaft hat im Geschäftsjahr einen Teilfonds zusammengelegt:

- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Green Bond - Global wurde zum 13.10.2022 mit dem JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Euro Broad zusammengelegt.

Eine Liste aller derzeit ausgegebenen Aktienklassen finden Sie im Abschnitt Informationen am Anfang des Berichts.

2. Wichtige Buchführungsgrundsätze

Darstellung des Abschlusses

Die Abschlüsse der Gesellschaft werden in Übereinstimmung mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Grundsätzen der Rechnungslegung und den luxemburgischen Vorschriften betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren erstellt.

Die konsolidierten Zahlen wurden nicht um Überkreuzinvestitionen von Teilfonds bereinigt. Per 30.06.2023 beliefen sich die Teilfonds-Überkreuzinvestitionen des Teilfonds JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities auf insgesamt 9 652 366.27 EUR. Somit liegt der konsolidierte NIW zum Ende des Jahres ohne Überkreuzinvestitionen insgesamt bei 4 779 195 031.03 EUR.

a) Umrechnung von Fremdwährungen

Die Anlagen ebenso wie andere Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen werden zum Wechselkurs vom 30.06.2023 umgerechnet. Fremdwährungsgeschäfte während des Jahres werden zu den am Tag der Transaktion geltenden Wechselkursen umgerechnet. Realisierte Nettogewinne und -verluste und die Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertsteigerungen und Wertminderungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und in den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens der einzelnen Teilfonds ausgewiesen.

b) Wertpapieranlagen

Wertpapiere, die an einer Börse oder einem anderen regulierten Zweitmarkt gehandelt werden, werden zum letzten bekannten Preis bewertet.

Sofern im Wertpapierbestand enthaltene Wertpapiere weder an einer Börse notiert noch auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden oder der erhaltene Preis nicht repräsentativ oder angemessen ist, wird das betreffende Wertpapier aufgrund eines vom Verwaltungsrat der Gesellschaft nach Treu und Glauben festgelegten, angemessenen und zu erwartenden Verkaufspreises bewertet.

c) Investmentfonds

Aktien oder Anteile an offenen Investmentfonds werden auf der Grundlage ihres zuletzt verfügbaren Nettoinventarwertes oder gemäß obigem Absatz b) zum Preis am Ort ihrer Notierung bewertet.

d) Devisentermingeschäfte

Devisentermingeschäfte werden zu den Terminmarktsätzen für die verbleibende Zeitdauer vom Bewertungsstichtag bis zur Fälligkeit des Kontrakts bewertet. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste, welche sich zum Stichtag aus der Bewertung offener Devisentermingeschäfte ergeben, sind in der Nettovermögensaufstellung berücksichtigt; die realisierten Nettogewinne und -verluste sowie Veränderungen bei nicht realisierten Nettogewinnen und -verlusten sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens aufgeführt.

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

2. Wichtige Buchführungsgrundsätze (Fortsetzung)

e) Optionsgeschäfte

Optionsgeschäfte werden zu dem Marktpreis zum Bewertungsstichtag bewertet. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste, welche sich zum Stichtag aus der Bewertung von Optionen ergeben, sind in der Nettovermögensaufstellung berücksichtigt; die realisierten Nettogewinne und -verluste sowie Nettoveränderungen bei nicht realisierten Gewinnen und Verlusten sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens aufgeführt.

f) Terminkontrakte

Terminkontrakte werden zu dem der jeweiligen Restlaufzeit entsprechenden Marktpreis zum Bewertungsstichtag bewertet. Nicht realisierte Nettogewinne oder -verluste, die sich zum Stichtag aus der Bewertung offener Terminkontrakte ergeben, sind in der Nettovermögensaufstellung berücksichtigt; die realisierten Nettogewinne und -verluste sowie Veränderungen bei nicht realisierten Nettogewinnen und -verlusten sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens aufgeführt.

g) CFD-Kontrakte (Contracts for difference)

CFD-Kontrakte werden durch den Marktpreis des jeweiligen zugrunde liegenden Wertpapiers (Underlying) zum Bewertungsstichtag bewertet. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste, die sich zum Stichtag aus der Bewertung offener CFD-Kontrakte ergeben, sind in der Nettovermögensaufstellung berücksichtigt; die realisierten Nettogewinne und -verluste sowie Veränderungen bei unrealisierten Nettogewinnen und -verlusten sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens aufgeführt. Sofern im Wertpapierbestand enthaltene Derivate weder an einer Börse notiert noch auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden oder sofern der wie oben beschrieben erhaltene Preis nicht repräsentativ ist oder keinen angemessenen Marktpreis des Derivates darstellt, wird das betreffende Derivat aufgrund eines nach Treu und Glauben berechneten, angemessenen und zu erwartenden Verkaufspreises bewertet. Die Zinsen im Zusammenhang mit den CFD-Kontrakten werden unter den sonstigen Erträgen bzw. den sonstigen Aufwendungen erfasst.

h) Swaps

Swap-Transaktionen werden in der Regel auf Grundlage der von der Gegenpartei der jeweiligen Swap-Transaktion erhaltenen Bewertungen bewertet. Bei diesen Werten kann es sich um Geld-, Brief- oder Mittelkurse handeln, die gemäß den vom Verwaltungsrat der Gesellschaft festgelegten Verfahren nach Treu und Glauben bestimmt werden können. Sollte der Verwaltungsrat der Gesellschaft der Auffassung sein, dass diese Werte nicht dem realen Marktwert der betreffenden Swap-Transaktionen entsprechen, so wird ihr Wert durch den Verwaltungsrat der Gesellschaft nach Treu und Glauben oder gemäß einer anderen Methode bestimmt, die dieser als angemessen erachtet.

i) Rundungsdifferenzen

Aus rechnerischen Gründen können in den Tabellen in diesem Jahresbericht, einschließlich des geprüften Abschlusses, Rundungsdifferenzen (Einheit, % usw.) auftreten.

j) Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Wertpapierportfolio

Der aus dem Wertpapierportfolio realisierte Nettogewinn/(-verlust) wird auf Grundlage der Durchschnittskosten der verkauften Wertpapieranlagen ermittelt.

k) Konsolidierte Zahlen

Die konsolidierten Zahlen der Gesellschaft lauten auf EUR und umfassen, ggf. umgerechnet, alle Abschlüsse der einzelnen Teilfonds.

l) Erträge aus Wertpapieranlagen

Dividenden werden am Ex-Dividendendatum als Erträge erfasst. Zinserträge laufen täglich auf.

3. Nettoinventarwert

a) Berechnung

Der Nettoinventarwert pro Aktie lautet auf die Währung des betreffenden Teilfonds und wird täglich berechnet, indem das Netto-Fondsvermögen des betreffenden Teilfonds durch die Anzahl ausgegebener und umlaufender Aktien des Teilfonds dividiert wird. Der Nettoinventarwert des Teilfonds am Tag T ist auf Basis der Marktpreise vom Tag T berechnet, wird aber am Tag T+1 publiziert. Die Einstandskosten von verkauften Wertpapieren werden nach der Methode des gewichteten Durchschnittspreises berechnet.

b) Rücknahme von Aktien

Der Aktionär eines Teilfonds ist jederzeit berechtigt, die Rücknahme seiner Aktien zum Nettoinventarwert pro Aktie zu verlangen, abzüglich einer Rücknahmegebühr von maximal 0.40% (Verwässerungsgebühr).

c) Ausgabe von Aktien

Der Zeichnungskurs wird wie folgt berechnet:

- Nettoinventarwert pro Aktie des betreffenden Teilfonds
- Kommission von max. 3.00% für die mit der Platzierung und dem Verkauf betraute Vertriebsstelle.

d) Umwandlung von Aktien

Der Aktionär ist berechtigt, zwischen den Teilfonds gemäß den im ausführlichen und vereinfachten Verkaufsprospekt enthaltenen Bedingungen hin und her zu wechseln.

e) Single Swing Pricing

Ergibt sich an einem beliebigen Handelstag aus der Summe der Zeichnungen oder Rücknahmen aller Aktienklassen eines Teilfonds ein Nettokapitalzufluss oder -abfluss, kann sich der Nettoinventarwert des betreffenden Teilfondsvermögens an diesem Handelstag erhöhen oder reduzieren (Single Swing Pricing). Diese Anpassung führt zu einem Anstieg des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl von Aktien des betreffenden Teilfonds führen. Sie führt zu einer Reduzierung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Verringerung der Anzahl von Aktien führen.

Der maximale anwendbare Swing-Faktor gemäß dem Prospekt entspricht 3% des Nettoinventarwertes.

Der maximale Swing-Faktor, der während des Jahres angewendet wurde, betrug 0.51%.

Ein partieller Single Swing Pricing-Mechanismus wird angewendet, d. h. ein Single Swing Pricing wird nur angewendet, wenn der Nettokapitalzufluss/-abfluss einen vordefinierten Schwellenwert überschreitet.

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

3. Nettoinventarwert (Fortsetzung)

e) Single Swing Pricing (Fortsetzung)

Während des Geschäftsjahres wurde das Swing Pricing für alle Teilfonds angewandt, mit Ausnahme derjenigen, die während des Geschäftsjahres aufgelöst oder zusammengelegt wurden.

Am letzten Tag des Geschäftsjahres wurde kein Swing Pricing angewandt.

4. Taxe d'abonnement

Die Gesellschaft unterliegt im Rahmen der gesetzlichen Bestimmungen in Luxemburg einer jährlichen Steuer („Taxe d'abonnement“) von 0.05%, bzw. 0.01% für institutionelle Aktienklassen des Nettovermögens des Fonds, die vierteljährlich jeweils am Ende jedes Quartals zahlbar ist. Die Gesellschaft unterliegt keiner luxemburgischen Einkommens-, Kapitalgewinn- oder Quellensteuer. Die Gesellschaft zahlt keine Steuer auf den Teil des Nettovermögens des Fonds, welcher in anderen Organismen für gemeinsame Anlagen angelegt ist, die bereits im Einklang mit den luxemburgischen gesetzlichen Vorschriften der „Taxe d'abonnement“ unterliegen.

5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr

Die folgenden Vergütungen der Verwaltungsgesellschaft stellen die Höchstsätze gemäß Prospekt dar und basieren auf dem an jedem Bewertungstag errechneten Wert des Nettovermögens des Teilfonds und sind vierteljährlich nachträglich zahlbar (zutreffend für alle Aktienklassen, falls nicht anderweitig vorgegeben):

Teilfonds	Klasse	ISIN	Maximale Verwaltungsgesellschaftsgebühr (%)
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C CHF acc hedged-	LU1073944271	0.85%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C EUR acc hedged-	LU1073944354	0.85%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C USD acc-	LU1073944198	0.85%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C USD dist-	LU1210450364	0.85%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-I CHF acc hedged-	LU1073944511	0.70%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-I USD acc-	LU1073944438	0.70%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-I USD dist-	LU1210450448	0.70%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P CHF acc hedged-	LU1073943893	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P EUR acc hedged-	LU1073943976	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P EUR dist hedged-	LU1244594351	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P USD acc-	LU1073943620	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P USD dist-	LU1210450281	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y CHF acc hedged-	LU1201473821	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y CHF dist hedged-	LU1244594948	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y EUR acc hedged-	LU1201474043	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y EUR dist hedged-	LU1244595085	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y GBP dist hedged-	LU1545798859	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y USD acc-	LU1201474126	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y USD dist-	LU1210450521	1.00%
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-C USD acc-	LU0950588334	1.15%
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-C USD dist-	LU1732170136	1.15%
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-I USD acc-	LU1111702400	1.05%
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-M USD acc-	LU1860229043	0.12%
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-P USD dist-	LU0068337053	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C EUR acc-	LU0950588763	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C EUR dist-	LU1732170649	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C GBP acc-	LU1354468743	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C H1 GBP dist-	LU2592797984	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C USD acc-	LU1111702822	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C USD dist-	LU2076226567	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-E USD acc-	LU2076227615	1.50%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-E USD dist-	LU2076227532	1.50%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-I USD acc-	LU1111703044	0.90%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-I10 EUR acc-	LU2569393635	0.90%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-M USD acc-	LU2076228340	0.12%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P EUR acc-	LU0533812276	1.50%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P EUR dist-	LU0375216479	1.50%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P USD acc-	LU1096892549	1.50%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P USD dist-	LU1732170565	1.50%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-S EUR acc-	LU1842717297	0.75%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-S EUR dist-	LU1842717370	0.75%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-Y EUR dist-	LU2076227706	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-Y USD acc-	LU2076228001	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-Y USD dist-	LU2076227961	1.25%
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)	-C CHF acc-	LU0950588920	1.00%

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr (Fortsetzung)

Teilfonds	Klasse	ISIN	Maximale Verwaltungsgesellschaftsgebühr (%)
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)	-C CHF dist-	LU1732170995	1.00%
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)	-P CHF dist-	LU0058890657	1.50%
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-C EUR acc-	LU0950589068	1.00%
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-C EUR dist-	LU1732171027	1.00%
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-P EUR dist-	LU0058893917	1.50%
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-S EUR acc-	LU1842716646	0.75%
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)	-P EUR acc-	LU0198388380	1.50%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C CHF acc hedged-	LU1111708860	0.90%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C EUR acc-	LU1111708787	0.90%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C GBP acc hedged-	LU1111709082	0.90%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C USD acc hedged-	LU1111708944	0.90%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I CHF acc hedged-	LU1111709322	0.80%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I EUR acc-	LU1111709249	0.80%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I USD acc hedged-	LU1111709595	0.80%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I USD dist hedged-	LU1244595754	0.80%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I10 CHF acc hedged-	LU2075973177	0.60%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I10 EUR acc-	LU2075973334	0.60%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I3 CHF acc hedged-	LU2075972286	0.70%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 CHF acc hedged-	LU1629314078	0.50%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 EUR acc-	LU1629313856	0.50%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 EUR dist-	LU1629313930	0.50%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 GBP dist hedged-	LU1629314581	0.50%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 USD acc hedged-	LU1629314235	0.50%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 USD dist hedged-	LU1629314318	0.50%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ3 CHF acc hedged-	LU2075975206	0.70%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ3 EUR acc-	LU2075975461	0.70%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ3 EUR dist-	LU2075975545	0.70%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ10 USD acc hedged-	LU2075977087	0.60%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ10 CHF acc hedged-	LU2075976600	0.60%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ10 GBP acc hedged-	LU2075977327	0.60%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P CHF acc hedged-	LU1111708431	1.10%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P EUR acc-	LU1111708357	1.10%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P EUR dist-	LU1210451099	1.10%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P USD acc hedged-	LU1111708514	1.10%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P USD dist hedged-	LU1244595242	1.10%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C CHF acc-	LU2076229074	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C EUR acc-	LU0950589498	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C EUR dist-	LU1732171373	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C GBP acc-	LU2076229405	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C USD acc-	LU1111703127	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I EUR acc-	LU0405184523	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I USD (BRL hedged) acc-	LU2067136072	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I USD acc-	LU1111703390	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I USD dist-	LU1991390706	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I10 CHF acc-	LU2008796604	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I10 EUR acc-	LU2008796273	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I10 USD acc-	LU2008796430	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I30 CHF acc-	LU2427699371	0.90%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-IH1 NOK acc-	LU2076230247	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-M CHF acc-	LU2499280977	0.12%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-M EUR acc-	LU0950589571	0.12%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P EUR acc-	LU0480508919	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P EUR dist-	LU0229773345	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P SGD acc-	LU2361429579	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P USD acc-	LU1111703473	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P USD dist-	LU1732171290	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-S EUR dist-	LU2076230833	0.75%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-Y EUR acc-	LU1205684001	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-Y USD dist-	LU2161043588	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C CHF acc hedged-	LU1073945245	0.75%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C EUR acc hedged-	LU1073945328	0.75%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C EUR dist hedged-	LU1244596133	0.75%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C USD acc-	LU1073945161	0.75%

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr (Fortsetzung)

Teilfonds	Klasse	ISIN	Maximale Verwaltungsgesellschaftsgebühr (%)
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C USD dist-	LU1210452063	0.75%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-I USD acc-	LU1073945591	0.65%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P CHF acc hedged-	LU1073944941	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P EUR acc hedged-	LU1073945088	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P USD acc-	LU1073944867	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P USD dist-	LU1210451842	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-Y CHF acc hedged-	LU1201473581	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-Y EUR acc hedged-	LU1201473664	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-Y USD dist-	LU1210452659	1.00%
JSS Sustainable Bond CHF	-C CHF acc-	LU0950591809	0.75%
JSS Sustainable Bond CHF	-M CHF acc-	LU0950591981	0.10%
JSS Sustainable Bond CHF	-P CHF dist-	LU0121751324	0.75%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-C CHF acc hedged-	LU2076224786	0.70%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-C EUR acc-	LU0950592104	0.70%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-C EUR dist-	LU1732171969	0.70%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-I EUR acc-	LU2076225163	0.70%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-I EUR dist-	LU2076225247	0.70%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-P CHF dist hedged-	LU2076224273	1.00%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-P EUR acc-	LU2076223622	1.00%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-P EUR dist-	LU0158938935	1.00%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-Y CHF acc hedged-	LU2076226054	0.60%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-Y EUR acc-	LU1752454568	0.60%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-Y EUR dist-	LU1752454485	0.60%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-C EUR acc-	LU0950591718	0.80%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-C EUR dist-	LU1732172009	0.80%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-I EUR acc-	LU0734492860	0.70%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-M EUR acc-	LU0776582891	0.10%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-P EUR dist-	LU0045164786	1.00%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-Y CHF dist hedged-	LU2312587103	1.00%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-Y EUR acc-	LU1205683706	1.00%
JSS Sustainable Equity - Europe	-C EUR acc-	LU0950592369	1.15%
JSS Sustainable Equity - Europe	-P EUR acc-	LU0484532444	1.75%
JSS Sustainable Equity - Europe	-P EUR dist-	LU0058891119	1.75%
JSS Sustainable Equity - Europe	-P USD acc-	LU1096900078	1.75%
JSS Sustainable Equity - Europe	-Y EUR acc-	LU1205683888	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-C CHF acc-	LU2273127774	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-C EUR acc-	LU0950592443	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-C USD acc-	LU1111704364	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-I CHF acc-	LU2273128319	1.05%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-I EUR acc-	LU1111704521	1.05%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-M CHF acc-	LU2499280894	0.12%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-M EUR acc-	LU0749004452	0.12%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-P EUR dist-	LU0097427784	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-P USD acc-	LU1111704448	1.75%
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-C EUR acc-	LU0950592872	1.00%
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-C EUR dist-	LU1991392827	1.00%
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-I EUR acc-	LU0950592955	0.90%
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-P EUR acc-	LU0288928376	1.50%
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-P EUR dist-	LU1991392074	1.50%
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-P USD acc-	LU1111705098	1.50%
JSS Sustainable Equity - USA	-C USD acc-	LU0950593094	1.15%
JSS Sustainable Equity - USA	-I USD acc-	LU1111705254	1.05%
JSS Sustainable Equity - USA	-I USD dist-	LU2076232961	1.05%
JSS Sustainable Equity - USA	-I10 USD acc-	LU2427700138	1.00%
JSS Sustainable Equity - USA	-P USD acc-	LU0526864581	1.75%
JSS Sustainable Equity - USA	-P USD dist-	LU2076232706	1.75%
JSS Sustainable Equity - USA	-Y USD acc-	LU1629314664	1.00%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-C EUR acc-	LU0950593177	1.15%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I EUR acc-	LU1842720168	1.10%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I EUR dist-	LU1842720242	1.10%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I H2 CHF dist-	LU2273130562	1.10%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I USD H2 acc-	LU1842720325	1.10%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P CHF H2 acc-	LU1111702079	1.75%

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr (Fortsetzung)

Teilfonds	Klasse	ISIN	Maximale Verwaltungsgesellschaftsgebühr (%)
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P EUR acc-	LU1111705338	1.75%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P EUR dist-	LU0058892943	1.75%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P USD H2 acc-	LU1842719665	1.75%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C CHF H1 acc-	LU1111702236	1.35%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C EUR acc-	LU0950593250	1.35%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C EUR dist-	LU1732172694	1.35%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C USD acc-	LU1111705684	1.35%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C USD dist-	LU1732172777	1.35%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I CHF acc-	LU1965939850	1.25%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I EUR acc-	LU0333595519	1.25%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I EUR dist-	LU1732172850	1.25%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I10 EUR acc-	LU2427703074	1.10%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P CHF H1 acc -	LU1111702319	2.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P EUR acc-	LU0707700596	2.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P EUR dist-	LU0333595436	2.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P GBP dist-	LU1545800341	2.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P USD H1 acc-	LU1120832198	2.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P USD dist-	LU0950593417	2.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-S EUR dist-	LU1842716729	1.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-Y EUR acc-	LU1205684183	1.00%
JSS Bond - USD High Yield	-C EUR acc hedged-	LU1184841341	1.30%
JSS Bond - USD High Yield	-C USD acc-	LU1184840962	1.30%
JSS Bond - USD High Yield	-C USD dist-	LU1210450109	1.30%
JSS Bond - USD High Yield	-I CHF acc hedged-	LU1184841937	1.00%
JSS Bond - USD High Yield	-I USD acc-	LU1184841770	1.00%
JSS Bond - USD High Yield	-I USD dist-	LU1210450018	1.00%
JSS Bond - USD High Yield	-P CHF acc hedged-	LU1184840293	1.50%
JSS Bond - USD High Yield	-P CHF dist hedged-	LU1184840459	1.50%
JSS Bond - USD High Yield	-P EUR acc hedged-	LU1184840533	1.50%
JSS Bond - USD High Yield	-P EUR dist hedged-	LU1184840707	1.50%
JSS Bond - USD High Yield	-P USD acc-	LU1184840020	1.50%
JSS Bond - USD High Yield	-P USD dist-	LU1210449945	1.50%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C CHF acc hedged-	LU1332517405	0.90%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C EUR acc hedged-	LU1332517660	0.90%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C USD acc-	LU1332517231	0.90%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C USD dist-	LU1332517314	0.90%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I CHF acc hedged-	LU1332518122	0.70%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I EUR acc hedged-	LU1332518478	0.70%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I EUR dist hedged-	LU1332518551	0.70%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I USD acc-	LU1332517827	0.70%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I USD dist-	LU1332518049	0.70%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-M CHF acc hedged-	LU1332518635	0.12%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P CHF acc hedged-	LU1332516852	1.40%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P EUR acc hedged-	LU1332517074	1.40%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P EUR dist hedged-	LU1332517157	1.40%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P USD acc-	LU1332516696	1.40%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P USD dist-	LU1332516779	1.40%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y CHF acc hedged-	LU1405747244	1.00%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y EUR acc hedged-	LU1405747327	1.00%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y GBP dist hedged-	LU1405749539	1.00%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y USD acc-	LU1405747087	1.00%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y USD dist-	LU1405747160	1.00%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-C EUR acc-	LU1752455532	1.50%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-C EUR dist-	LU1752455615	1.50%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-C USD acc-	LU1752455375	1.50%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-E EUR acc-	LU2161045799	1.60%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-E EUR dist-	LU2161045872	1.60%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-I USD acc-	LU1752455888	1.25%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P EUR acc-	LU1752454998	1.75%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P EUR dist-	LU1752455292	1.75%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P USD acc-	LU1752454642	1.75%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P USD dist-	LU1752454725	1.75%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-Y USD acc-	LU1752456001	1.25%

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr (Fortsetzung)

Teilfonds	Klasse	ISIN	Maximale Verwaltungsgesellschaftsgebühr (%)
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-Y USD dist-	LU1752456266	1.25%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C CHF acc-	LU1842718345	1.50%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C EUR acc-	LU1752457405	1.50%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C USD acc-	LU1752456936	1.50%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C USD dist-	LU1752457157	1.50%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-E USD acc-	LU1842717453	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-E USD dist-	LU1842717537	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I CHF acc-	LU1842718691	1.00%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I EUR acc-	LU2076231567	1.00%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I USD (BRL hedged) acc-	LU1842717883	1.00%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I USD acc-	LU1752458551	1.00%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I10 USD acc-	LU2273126701	0.90%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-M USD acc-	LU1842718006	0.12%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P CHF dist-	LU1842718261	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P EUR acc-	LU1752456696	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P USD dist-	LU1752456852	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P USD acc-	LU1752456340	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P USD dist-	LU1752456423	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-Y USD acc-	LU1752458049	1.25%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-Y USD dist-	LU1752458478	1.25%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-C USD acc-	LU1835934479	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-C USD dist-	LU1835934552	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-I USD acc-	LU1835934636	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-I USD dist-	LU1835934719	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-M USD acc-	LU1835935013	0.12%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-P USD acc-	LU1835934123	1.75%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-P USD dist-	LU1835934396	1.75%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-Y USD acc-	LU1835934800	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-Y USD dist-	LU1835934982	1.00%
JSS Equity - All China	-C CHF acc-	LU1965940783	1.50%
JSS Equity - All China	-C EUR acc-	LU1965940510	1.50%
JSS Equity - All China	-C USD acc-	LU1900873875	1.50%
JSS Equity - All China	-C USD dist-	LU1900873958	1.50%
JSS Equity - All China	-I CHF acc-	LU1965941161	1.25%
JSS Equity - All China	-I EUR acc-	LU1965940940	1.25%
JSS Equity - All China	-I USD acc-	LU1900874097	1.25%
JSS Equity - All China	-I10 USD acc-	LU2273125992	1.10%
JSS Equity - All China	-P CHF acc-	LU1965940353	2.00%
JSS Equity - All China	-P CHF dist-	LU1965940437	2.00%
JSS Equity - All China	-P EUR acc-	LU1965940197	2.00%
JSS Equity - All China	-P USD acc-	LU1900873529	2.00%
JSS Equity - All China	-P USD dist-	LU1900873792	2.00%

6. Verwahrstellengebühr

Die Verwahrstelle wird gemäß den normalen Bankusancen in Luxemburg entschädigt.

7. Dividendenpolitik

Die Gesellschaft hat entschieden, für das Geschäftsjahr auf folgende ausschüttende Aktien eine Dividende auszusahlen.

	Aktienklasse	ISIN	Währung	Betrag
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y EUR dist hedged	LU1244595085	USD	1.59*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	C USD dist	LU1210450364	USD	1.43
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	P USD dist	LU1210450281	USD	1.20
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y CHF dist hedged	LU1244594948	USD	1.54*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y GBP dist hedged	LU1545798859	USD	1.91*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y USD dist	LU1210450521	USD	1.47
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	P EUR dist hedged	LU1244594351	USD	1.16*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	I USD dist	LU1210450448	USD	1.49
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	Y USD dist	LU2076227961	USD	2.30
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	S EUR dist	LU1842717370	USD	1.93*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	C EUR dist	LU1732170649	USD	1.47*

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

7. Dividendenpolitik (Fortsetzung)

	Aktienklasse	ISIN	Währung	Betrag
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	P EUR dist	LU0375216479	USD	1.44*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	C USD dist	LU2076226567	USD	1.13
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	I USD dist hedged	LU1244595754	EUR	3.53*
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	I30 EUR dist	LU1629313930	EUR	3.73
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	I30 USD dist hedged	LU1629314318	EUR	3.39*
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	P USD dist hedged	LU1244595242	EUR	2.98*
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	P EUR dist	LU1210451099	EUR	2.90
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	I30 EUR dist	LU2075975545	EUR	3.59
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	C EUR dist hedged	LU1244596133	USD	1.19*
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	C USD dist	LU1210452063	USD	1.09
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	P USD dist	LU1210451842	USD	1.05
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	Y USD dist	LU1210452659	USD	1.25
JSS Sustainable Equity - Europe	P EUR dist	LU0058891119	EUR	1.46
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	P EUR dist	LU0058892943	EUR	1.95
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	I H2 CHF dist	LU2273130562	EUR	1.53*
JSS Bond - USD High Yield	P CHF dist hedged	LU1184840459	USD	1.89*
JSS Bond - USD High Yield	I USD dist	LU1210450018	USD	2.31
JSS Bond - USD High Yield	P USD dist	LU1210449945	USD	2.02
JSS Bond - USD High Yield	C USD dist	LU1210450109	USD	2.18
JSS Bond - USD High Yield	P EUR dist hedged	LU1184840707	USD	1.97*
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	Y GBP dist hedged	LU1405749539	USD	2.48*
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	Y USD dist	LU1405747160	USD	1.99
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	I USD dist	LU1332518049	USD	1.89
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	C USD dist	LU1332517314	USD	1.68
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	I EUR dist hedged	LU1332518551	USD	1.94*
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	P USD dist	LU1332516779	USD	1.42
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	P EUR dist hedged	LU1332517157	USD	1.34*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	I USD dist	LU1835934719	USD	2.58
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	P USD dist	LU1835934396	USD	2.18
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	C USD dist	LU1835934552	USD	2.41
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	Y USD dist	LU1835934982	USD	2.59

*Die Ausschüttungsbeträge in Teilfondswährung werden umgerechnet und zum Wechselkurs vom 06.10.2022 (Ex-Tag) in der Währung der Aktienklasse ausgezahlt.

	Aktienklasse	ISIN	Währung	Betrag
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	C USD dist	LU1210452063	USD	1.27
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	C EUR dist hedged	LU1244596133	USD	1.27**
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	P USD dist	LU1210451842	USD	1.24
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	Y USD dist	LU1210452659	USD	1.42
JSS Bond - USD High Yield	C USD dist	LU1210450109	USD	2.24
JSS Bond - USD High Yield	I USD dist	LU1210450018	USD	2.35
JSS Bond - USD High Yield	P USD dist	LU1210449945	USD	5.99
JSS Bond - USD High Yield	P EUR dist hedged	LU1184840707	USD	1.89**
JSS Bond - USD High Yield	P CHF dist hedged	LU1184840459	USD	1.90**
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	C USD dist	LU1332517314	USD	3.22
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	I USD dist	LU1332518049	USD	2.86
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	I EUR dist hedged	LU1332518551	USD	2.75**
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	Y USD dist	LU1405747160	USD	1.11
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	Y GBP dist hedged	LU1405749539	USD	1.21**
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	C USD dist	LU1835934552	USD	1.87
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	I USD dist	LU1835934719	USD	2.06
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	P USD dist	LU1835934396	USD	1.69
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	Y USD dist	LU1835934982	USD	2.05
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	C USD dist	LU1210450364	USD	1.30
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	I USD dist	LU1210450448	USD	1.34
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	P USD dist	LU1210450281	USD	1.11
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	P EUR dist hedged	LU1244594351	USD	0.98**
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y USD dist	LU1210450521	USD	1.33
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y CHF dist hedged	LU1244594948	USD	1.33**
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y EUR dist hedged	LU1244595085	USD	1.31**
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y GBP dist hedged	LU1545798859	USD	1.54**

**Die Ausschüttungsbeträge in Teilfondswährung werden umgerechnet und zum Wechselkurs vom 31.03.2023 (Ex-Tag) in der Währung der Aktienklasse ausgezahlt.

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

8. Total Expense Ratio (TER)

Die TER wurde gemäß der „Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der TER“ des Schweizerischen Anlagefondsverbands („Swiss Funds and Asset Management Association“, „SFAMA“) in der Fassung vom 20.04.2015 ermittelt.

Abhängig von den Umständen sind die Transaktionskosten entweder im Kaufpreis der Wertpapiere enthalten und/oder gesondert in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens ausgewiesen. Diese Kosten, die gemäß oben genannter Richtlinie nicht zum Betriebsaufwand gehören (vgl. Ziffer 3 der Richtlinie), werden damit nicht bei der TER-Berechnung berücksichtigt.

9. Devisentermingeschäfte

Folgende Devisentermingeschäfte standen zum 30.06.2023 offen:

Gegenparteien: Bank J. Safra Sarasin Ltd, RBC Investor Services Bank S.A., The Bank of New York Mellon S.A. und Royal Bank of Canada London.

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
32 199 277	CHF	35 978 643	USD	14.09.2023
52 323 253	EUR	56 826 994	USD	14.09.2023
5 283 571	GBP	6 648 514	USD	14.09.2023
230 991	USD	204 936	CHF	14.09.2023
213 383	USD	194 677	EUR	14.09.2023
192 428	USD	150 278	GBP	14.09.2023
899 888	USD	800 000	CHF	15.09.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 856 787.51 USD.

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
68	THB	2	USD	05.07.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 0.01 USD.

JSS Sustainable Equity - Global Dividend

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
1 856	CAD	1 105	GBP	14.07.2023
5 038	CHF	4 470	GBP	14.07.2023
83 886	DKK	9 765	GBP	14.07.2023
10 462	EUR	8 983	GBP	14.07.2023
38 686	GBP	64 909	CAD	14.07.2023
55 587	GBP	61 892	CHF	14.07.2023
24 651	GBP	211 209	DKK	14.07.2023
238 532	GBP	274 497	EUR	14.07.2023
685 996	GBP	853 833	USD	14.07.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 23 654.00 USD.

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
179 090	CHF	199 225	USD	03.07.2023
212 603	USD	191 280	CHF	03.07.2023
65 573 091	CHF	67 365 000	EUR	21.09.2023
17 678 293	CHF	19 710 000	USD	21.09.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 330 854.92 CHF.

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
75 010	EUR	81 558	USD	03.07.2023
86 071	USD	79 275	EUR	03.07.2023
6 658 744	EUR	7 228 000	USD	21.09.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 61 782.86 EUR.

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

9. Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
33 209	EUR	36 108	USD	03.07.2023
36 231	USD	33 370	EUR	03.07.2023
4 785 857	EUR	5 195 000	USD	21.09.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 44 449.67 EUR.

JSS Twelve Sustainable Insurance Bond

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
122 572 524	EUR	106 037 000	GBP	31.07.2023
15 557 720	EUR	17 014 000	USD	31.07.2023
143 592 190	CHF	148 239 224	EUR	07.09.2023
1 246 144	EUR	1 213 002	CHF	07.09.2023
1 627 910	GBP	1 882 458	EUR	07.09.2023
46 344 576	USD	43 150 330	EUR	07.09.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Verlust in Höhe von (2 196 759.20) EUR.

JSS Sustainable Equity - Global Thematic

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
9 033 233	EUR	9 819 913	USD	03.07.2023
480	JPY	3	EUR	03.07.2023
10 219 507	USD	9 409 530	EUR	03.07.2023
433 748 151	BRL	86 475 572	USD	14.07.2023
826 811	EUR	9 758 876	NOK	14.07.2023
211 635	GBP	2 867 933	NOK	14.07.2023
985 119	HKD	1 364 928	NOK	14.07.2023
11 707 021	JPY	902 485	NOK	14.07.2023
29 878 011	NOK	2 576 746	EUR	14.07.2023
23 318 741	NOK	1 763 998	GBP	14.07.2023
10 815 630	NOK	8 038 596	HKD	14.07.2023
10 572 556	NOK	134 788 159	JPY	14.07.2023
125 022 961	NOK	11 916 216	USD	14.07.2023
3 103 600	USD	15 666 985	BRL	14.07.2023
959 216	USD	10 430 580	NOK	14.07.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 2 508 079.26 EUR.

JSS Sustainable Bond - Global Short-term

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
5 392 387	CHF	6 039 524	USD	14.09.2023
47 831 665	EUR	51 844 694	USD	14.09.2023
24 698	USD	22 008	CHF	14.09.2023
120 981	USD	111 923	EUR	14.09.2023
1 687 289	USD	1 500 000	CHF	15.09.2023
11 782 594	USD	10 800 000	EUR	15.09.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 528 413.88 USD.

JSS Sustainable Bond - Euro Broad

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
19 749 824	CHF	20 319 021	EUR	14.07.2023
63 889	EUR	62 341	CHF	14.07.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Verlust in Höhe von (71 110.20) EUR.

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

9. Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
14 856 178	CHF	15 336 681	EUR	07.09.2023
221 569	EUR	216 067	CHF	07.09.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Verlust in Höhe von (60 698.73) EUR.

JSS Sustainable Equity - Real Estate Global

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
22 593	EUR	3 558 125	JPY	03.07.2023
12 933	EUR	14 120	USD	03.07.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 14.56 EUR.

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
1 633 451	CHF	1 680 254	EUR	14.07.2023
567 175	EUR	553 272	CHF	14.07.2023
256 132	EUR	279 274	USD	14.07.2023
845 146	USD	768 205	EUR	14.07.2023
7 300 000	AUD	4 416 747	EUR	21.09.2023
8 919 485	EUR	14 400 000	AUD	21.09.2023
9 405 907	EUR	8 100 000	GBP	21.09.2023
38 601 935	EUR	42 300 000	USD	21.09.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 179 186.31 EUR.

JSS Sustainable Equity - Green Planet

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
500	HKD	59	EUR	03.07.2023
59 428	CAD	39 433	CHF	14.07.2023
134 087	CAD	99 386	USD	14.07.2023
1 062 330	CHF	1 605 104	CAD	14.07.2023
530 666	CHF	4 063 869	DKK	14.07.2023
4 220 019	CHF	4 341 281	EUR	14.07.2023
821 417	CHF	736 298	GBP	14.07.2023
225 393	CHF	1 992 168	HKD	14.07.2023
979 186	CHF	148 200 906	JPY	14.07.2023
9 784 014	CHF	11 071 049	USD	14.07.2023
357 998	DKK	46 827	CHF	14.07.2023
432 435	DKK	62 743	USD	14.07.2023
547 122	EUR	534 050	CHF	14.07.2023
768 611	EUR	833 162	USD	14.07.2023
44 128	GBP	49 565	CHF	14.07.2023
99 905	GBP	124 908	USD	14.07.2023
130 920	HKD	15 013	CHF	14.07.2023
221 979	HKD	28 407	USD	14.07.2023
5 848 810	JPY	36 470	CHF	14.07.2023
19 116 532	JPY	137 623	USD	14.07.2023
1 023 845	USD	1 366 762	CAD	14.07.2023
945 248	USD	837 056	CHF	14.07.2023
497 628	USD	3 369 698	DKK	14.07.2023
4 174 902	USD	3 797 936	EUR	14.07.2023
829 608	USD	657 061	GBP	14.07.2023
219 967	USD	1 720 165	HKD	14.07.2023
990 936	USD	132 777 317	JPY	14.07.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Verlust in Höhe von (8 110.63) EUR.

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

9. Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

JSS Bond - USD High Yield

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
1 515 565	CHF	1 716 808	USD	14.07.2023
9 778 230	EUR	10 768 299	USD	14.07.2023
337 167	USD	311 205	EUR	14.07.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Verlust in Höhe von (115 377.44) USD.

JSS Sustainable Bond - Total Return Global

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
5 392	CHF	6 008	USD	03.07.2023
74 014	EUR	80 682	USD	03.07.2023
14 665 654	USD	19 300 000	SGD	19.07.2023
17 797 445	USD	178 000 000	NOK	24.07.2023
500 000	GBP	631 975	USD	21.08.2023
11 453 451	USD	9 200 000	GBP	21.08.2023
27 693 120	USD	41 600 000	AUD	22.08.2023
104 139 263	CHF	116 237 155	USD	08.09.2023
102 691 988	EUR	110 496 613	USD	08.09.2023
6 505 811	GBP	8 096 528	USD	08.09.2023
2 478 375	USD	2 205 700	CHF	08.09.2023
4 445 215	USD	4 093 640	EUR	08.09.2023
251 157	USD	196 256	GBP	08.09.2023
9 293 819	USD	12 500 000	SGD	10.10.2023
26 500 840	USD	24 400 000	EUR	16.10.2023
9 838 437	USD	40 800 000	PLN	16.10.2023
15 080 460	USD	22 200 000	AUD	24.10.2023
29 764 659	USD	44 900 000	AUD	07.11.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 4 022 710.38 USD.

JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
7 712 486	BRL	1 538 925	USD	14.07.2023
69 019	USD	350 645	BRL	14.07.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 52 152.34 USD.

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
4 500 000	BRL	904 523	USD	20.09.2023
2 500 000	CNH	353 962	USD	20.09.2023
22 000 000	CZK	1 008 342	USD	20.09.2023
200 000 000	HUF	570 613	USD	20.09.2023
30 000 000	MXN	1 723 593	USD	20.09.2023
2 000 000	MYR	435 920	USD	20.09.2023
1 700 000	PEN	462 396	USD	20.09.2023
6 700 000	PLN	1 638 542	USD	20.09.2023
85 000 000	THB	2 480 303	USD	20.09.2023
516 273	USD	2 500 000	BRL	20.09.2023
2 349 235	USD	44 000 000	ZAR	20.09.2023
626 959	USD	50 000 000	RUB	20.12.2023
8 000 000	TRY	245 851	USD	20.06.2024

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Gewinn in Höhe von 111 882.83 USD.

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

9. Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

JSS Equity - All China

Kauf		Verkauf		Fälligkeit
16 395	EUR	17 914	USD	03.07.2023
5 144	USD	40 337	HKD	03.07.2023
45 537	USD	356 975	HKD	06.07.2023

Zum Stichtag entstand aus den offenen Positionen ein nicht realisierter Verlust in Höhe von (45.64) USD.

10. Terminkontrakte

Gegenpartei: Bank J. Safra Sarasin Ltd.

Per 30.06.2023 bestanden für den JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG folgende Verpflichtungen aus offenen Terminkontrakten:

Bezeichnung	Währung	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung USD	Nicht realisierter Gewinn/Verlust: USD
10Y TREASURY NOTES USA	USD	-50	-4 946 000.00	33 593.75
				<u>33 593.75</u>

Per 30.06.2023 bestanden für den JSS Sustainable Bond - Euro Broad folgende Verpflichtungen aus offenen Terminkontrakten:

Bezeichnung	Währung	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung EUR	Nicht realisierter Gewinn/Verlust: EUR
EURO BOBL	EUR	-61	-5 988 675.00	-16 606.44
EURO-BUXL-FUTURES	EUR	1	79 520.00	2 460.46
EURO-BUXL-FUTURES	EUR	-6	-477 120.00	370.00
SHORT EURO BTP ITALIAN BOND	EUR	-1	-97 220.00	520.00
SHORT EURO BTP ITALIAN BOND	EUR	1	97 220.00	-112.73
EURO SCHATZ	EUR	1	99 255.00	-247.72
EURO SCHATZ	EUR	-1	-99 255.00	520.00
10Y BTP ITALIAN BOND	EUR	1	103 540.00	500.94
10Y BTP ITALIAN BOND	EUR	-1	-103 540.00	-1 300.00
EURO BOBL	EUR	61	5 988 675.00	30 054.07
EURO OAT FUT FRENCH GVT BDS	EUR	-1	-99 770.00	54.19
EURO OAT FUT FRENCH GVT BDS	EUR	1	99 770.00	1 166.90
EURO BUND	EUR	-1	-94 560.00	608.90
EURO BUND	EUR	91	8 604 960.00	-26 007.28
				<u>-8 018.71</u>

Per 30.06.2023 bestanden für den JSS Sustainable Bond - EUR Corporates folgende Verpflichtungen aus offenen Terminkontrakten:

Bezeichnung	Währung	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung EUR	Nicht realisierter Gewinn/Verlust: EUR
EURO BOBL	EUR	-1	-98 175.00	-536.42
EURO BOBL	EUR	1	98 175.00	160.00
10Y BTP ITALIAN BOND	EUR	-1	-103 540.00	-360.00
10Y BTP ITALIAN BOND	EUR	1	103 540.00	296.19
EURO OAT FUT FRENCH GVT BDS	EUR	1	99 770.00	-17.62
EURO OAT FUT FRENCH GVT BDS	EUR	-1	-99 770.00	-98.10
EURO BUND	EUR	41	3 876 960.00	-7 466.89
EURO BUND	EUR	-11	-1 040 160.00	6 378.75
				<u>-1 644.09</u>

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

10. Terminkontrakte (Fortsetzung)

Per 30.06.2023 bestanden für den JSS Sustainable Bond - Total Return Global folgende Verpflichtungen aus offenen Terminkontrakten:

Bezeichnung	Währung	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung USD	Nicht realisierter Gewinn/Verlust: USD
LONG GILT STERLING FUTURES	GBP	140	11 526 567.64	101 453.73
JAPANESE GOV. BDS FUTURE 10Y	JPY	-22	-15 107 905.96	-60 538.97
5Y TREASURY NOTES USA	USD	220	21 676 600.00	-245 117.27
30Y TREASURY NOTES USA	USD	-42	-3 783 360.00	-99 304.67
USA 6% 96-15.02.26 TBO	USD	40	3 895 200.00	-139 375.00
				-442 882.18

Per 30.06.2023 bestanden für den JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency folgende Verpflichtungen aus offenen Terminkontrakten:

Bezeichnung	Währung	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung USD	Nicht realisierter Gewinn/Verlust: USD
10Y TREASURY NOTES USA	USD	5	494 600.00	-7 968.75
				-7 968.75

11. Eventualverpflichtungen aus Optionen

Gegenpartei: Bank J. Safra Sarasin Ltd und Goldman Sachs International LT.

Eventualverpflichtungen aus Optionen bestehen per 30.06.23 wie folgt:

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)	-1 344 161.14	CHF
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-529 445.63	EUR
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)	-200 930.43	EUR
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-32 377 689.16	EUR

Die Gesellschaft hatte zum Stichtag folgende offene Verpflichtungen aus Optionen.

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)

Bezeichnung	Währung	Put/Call	Strike	Fälligkeit	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung	Marktwert
EURO STOXX 50 PR	EUR	PUT	4 300.00	15.09.2023	47	-636 105.72	27 433.22
EURO STOXX 50 PR	EUR	PUT	3 700.00	15.09.2023	-47	90 584.68	-4 266.37
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	3 500.00	15.09.2023	-5	43 761.10	-2 415.55
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	3 950.00	15.12.2023	-15	760 349.13	-59 610.51
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	4 000.00	15.09.2023	5	-169 574.27	8 047.37
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	4 250.00	15.12.2023	15	-1 433 176.06	108 686.51

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)

Bezeichnung	Währung	Put/Call	Strike	Fälligkeit	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung	Marktwert
EURO STOXX 50 PR	EUR	PUT	4 300.00	15.09.2023	17	-235 723.36	10 166.00
EURO STOXX 50 PR	EUR	PUT	3 700.00	15.09.2023	-17	33 568.20	-1 581.00
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	3 950.00	15.12.2023	-6	311 598.46	-24 428.96
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	4 250.00	15.12.2023	6	-587 329.47	44 540.79
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	3 500.00	15.09.2023	-2	17 933.72	-989.92
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	4 000.00	15.09.2023	2	-69 493.18	3 297.89

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)

Bezeichnung	Währung	Put/Call	Strike	Fälligkeit	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung	Marktwert
EURO STOXX 50 PR	EUR	PUT	4 300.00	15.09.2023	7	-97 062.56	4 186.00
EURO STOXX 50 PR	EUR	PUT	3 700.00	15.09.2023	-7	13 822.20	-651.00
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	3 500.00	15.09.2023	-1	8 966.86	-494.96
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	4 250.00	15.12.2023	2	-195 776.49	14 846.93
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	3 950.00	15.12.2023	-2	103 866.15	-8 142.99
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	4 000.00	15.09.2023	1	-34 746.59	1 648.95

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

11. Eventualverpflichtungen aus Optionen (Fortsetzung)

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities

Bezeichnung	Währung	Put/Call	Strike	Fälligkeit	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung	Marktwert
EURO STOXX 50 PR	EUR	CALL	4 575.00	15.12.2023	-140	-2 395 848.00	-137 620.00
EURO STOXX 50 PR	EUR	PUT	3 300.00	15.12.2023	-140	258 014.40	-20 440.00
EURO STOXX 50 PR	EUR	PUT	4 225.00	15.12.2023	140	-1 799 957.60	130 760.00
SPX - S&P 500 INDICES	USD	CALL	4 550.00	15.12.2023	-110	-20 384 666.74	-1 508 845.10
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	4 200.00	15.12.2023	110	-9 658 057.83	731 989.00
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	3 300.00	15.12.2023	-110	1 602 826.62	-144 179.65

12. Swap-Transaktionen

Gegenpartei: Bank J. Safra Sarasin Ltd.

Zinsswaps

JSS Sustainable Bond - Euro Broad

Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn/Verlust EUR	Fälligkeit
EUR	-5 000 000.00	34 934.03	08.09.2033
EUR	-5 000 000.00	34 084.69	08.09.2033
EUR	-5 000 000.00	38 246.53	08.09.2033
EUR	-5 000 000.00	41 219.29	08.09.2033
EUR	4 000 000.00	-21 636.19	08.09.2038
EUR	-4 000 000.00	37 531.69	08.09.2043
EUR	2 500 000.00	-132 991.89	08.09.2072
		31 388.15	

Credit Default Swap

JSS Sustainable Bond - Total Return Global

Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn/Verlust USD	Fälligkeit
EUR	10 000 000.00	215 770.02	20.06.2027
		215 770.02	

13. Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung und Sicherheiten

Unter „effizienter Portfolioverwaltung“ werden folgende Techniken verstanden:

- Wertpapierleihe
- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Die Gesellschaft wendet keine dieser Techniken an. Die Gesellschaft berücksichtigt bei der Berechnung der Grenzen für das Kontrahentenrisiko keine erhaltenen Sicherheiten. Aus diesem Grund wird auf Angaben zu zulässigen Arten von Sicherheiten, zum erforderlichen Umfang der Besicherung und zur Haircut-Strategie sowie, im Fall von Barsicherheiten, zur Strategie für das erneute Anlegen (einschließlich der damit verbundenen Risiken) verzichtet.

14. Wechselkurse zur Konsolidierung

1 EUR	=	0.976063	CHF
		1.091000	USD

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

15. Erhaltene Sicherheiten

Teilfonds	Währung	Betrag	Gezahlt/erhalten	Gegenpartei
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	USD	590 000.00	erhalten	Bank J. Safra Sarasin Ltd
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)	EUR	281 244.00	erhalten	Bank of New York Mellon
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	EUR	550 000.00	gezahlt	RBC Investor Services Bank S.A.
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	EUR	1 400 000.00	gezahlt	Bank J. Safra Sarasin Ltd
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	USD	2 440 000.00	erhalten	Royal Bank of Canada London
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	EUR	180 000.00	gezahlt	RBC Investor Services Bank S.A.
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	USD	611 000.00	erhalten	Bank J. Safra Sarasin Ltd
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	EUR	20 000.00	erhalten	Bank J. Safra Sarasin Ltd
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	EUR	220 000.00	erhalten	Bank J. Safra Sarasin Ltd
JSS Bond - USD High Yield	USD	280 000.00	gezahlt	RBC Investor Services Bank S.A.
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	USD	4 210 000.00	erhalten	Bank J. Safra Sarasin Ltd

16. Transaktionsgebühr

Durch den Kauf oder Verkauf von übertragbaren Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten, Derivaten oder sonstigen zulässigen Vermögenswerten entstehen der Gesellschaft Transaktionskosten.

Die Transaktionskosten umfassen Maklergebühren, Stempelgebühren, örtliche Steuern und fremde Gebühren, die in den Kosten der gekauften und verkauften Wertpapiere enthalten sind und die einem Teilfonds zusätzlich zu den angegebenen Transaktionskosten in Rechnung gestellt wurden. Sie sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen.

Für das Geschäftsjahr zum 30.06.2023 sind in der Gesellschaft folgende Transaktionskosten in Verbindung mit dem Kauf oder Verkauf von Anlagen in Wertpapieren und ähnlichen Transaktionen entstanden:

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	356 730.04	USD
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	61 077.36	USD
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	603 326.05	USD
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)	30 779.22	CHF
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	11 463.45	EUR
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)	7 201.77	EUR
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	0.00	EUR
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	422 326.82	EUR
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	168 854.27	USD
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	503.56	EUR
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	731.63	EUR
JSS Sustainable Equity - Europe	40 563.81	EUR
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	124 735.68	EUR
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	16 109.73	EUR
JSS Sustainable Equity - USA	229 619.13	USD
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	398 053.79	EUR
JSS Sustainable Equity - Green Planet	240 695.19	EUR
JSS Bond - USD High Yield	2 299.14	USD
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	57 331.93	USD
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	151 297.46	USD
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	398 276.59	USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	11 052.89	USD
JSS Equity - All China	1 288 751.06	USD

Des Weiteren, im Einklang mit den handelsüblichen Marktpraktiken an Rentenmärkten, unterliegen Käufe und Verkäufe dem „Bid-Offer-Spread“ (Differenz zwischen Kauf-/Verkaufspreis und Marktwert), welcher dem Entgelt des Brokers entspricht.

17. Ereignisse während des Jahres

Mit Wirkung zum 13.10.2022 wurde der JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Green Bond - Global mit dem JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Euro Broad zusammengelegt.

Am 24.02.2022 marschierten die russischen Truppen in die Ukraine ein. Als Reaktion darauf haben mehrere Länder, darunter die Europäische Union, die Schweiz, das Vereinigte Königreich, die Vereinigten Staaten von Amerika, Kanada, Japan und Australien, mehrschichtige Wirtschaftssanktionen gegen Russland verhängt. Darüber kam es zu einer Aussetzung der Notierung einer Reihe börsennotierter russischer Unternehmen an bestimmten Börsen und/oder zu deren Ausschluss aus Marktindizes.

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2023 (Fortsetzung)

17. Ereignisse während des Jahres (Fortsetzung)

Zum Ende des Geschäftsjahres sind die folgenden Teilfonds in auf USD lautenden russischen Anleihen engagiert, die von internationalen Sanktionen betroffen sind:

Teilfonds	Russisches Wertpapier	ISIN	Gewichtung (in % des NIW zum 30.06.2023)	
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Alfa Bk 5.95% 19-15.04.30	XS2063279959	0.01%	
	Vtb Cap 6.95% 12-17.10.22	XS0842078536	0.00%	
	Sb Capital 5.25% 13-23.05.23		XS0935311240	0.01%
				0.02%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	Sb Capital 5.25% 13-23.05.23	XS0935311240	0.01%	
			0.01%	
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	EBRD 5.0% 19-05.11.24	XS2075938188	0.23%	
			0.23%	

Diese Positionen wurden mit dem Fondsverwalter gemäß der Preisvereinbarung zum 30.06.2023 bewertet.

Abgesehen von diesen Positionen ist der Teilfonds JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency in auf RUB lautende russische Anleihen investiert. Auf der Grundlage der aktuellen Marktbedingungen und der Entwicklung nach Börsenschluss sowie der Tatsache, dass es in der EU keinen ausführbaren und handelbaren Preis für diese Wertpapiere gibt, hat der Verwaltungsrat des Fonds per Umlaufbeschluss vom 25.10.2023 beschlossen, alle auf RUB lautenden russischen Anleihen, die dieser Teilfonds zum 30.06.2023 hält, auf null abzuschreiben. Diese Bewertung berücksichtigt die Sanktionsregelung in der EU und deren Auswirkungen auf die Handelbarkeit und Abwicklung der betreffenden Wertpapiere.

Darüber hinaus ist im Teilfonds JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency ein Handel mit einer auf RUB lautenden russischen Anleihe vom 14.02.2022 aufgrund der Sanktionsregelung in der EU und deren Auswirkungen auf die Handelbarkeit und Abwicklung des Wertpapiers RUSSIA 7.1% 17-16.10.24 noch nicht abgewickelt. Infolgedessen hat der Verwaltungsrat des Fonds per Umlaufbeschluss vom 25.10.2023 beschlossen und angewiesen, eine Rückstellung zur Verrechnung des Abrechnungsbetrags eines solchen Handels zu bilden.

Diese Entscheidungen in Bezug auf die Bewertung und Abschreibung wurden im NIW des Teilfonds JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency im aktuellen Abschluss des Fonds zum 30.06.2023 berücksichtigt, wodurch sich dieser folglich um -6.55% vom offiziellen NIW unterscheidet. Die Tabelle zum Vergleich des Nettoinventarwerts, die Wertentwicklung des Fonds, die Aufstellung des Nettovermögens, die Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens und die Aufstellung des Wertpapierbestands und des sonstigen Nettovermögens wurden entsprechend aktualisiert.

Nachstehend die Liste der auf RUB lautenden, im aktuellen Jahresabschluss mit Null ausgewiesenen Anleihen:

Beschreibung	ISIN	Nominell (in RUB)	Indikativer Wert - nicht handelbarer Marktpreis
RUSSIA 7.05% 13-19.01.28/FLAT	RU000A0JTK38	70 000 000.00	39%
MIN FIN RUF 7.70% 16.3.39/FLAT	RU000A100EF5	75 000 000.00	39%
MIN FIN RUF 6.9% 23.05.29/FLAT	RU000A0ZYUA9	70 000 000.00	39%
RUSSIA 8.15% 3.2.27 S 26207/FLAT	RU000A0JS3W6	115 000 000.00	39%
RUSSIA 7.1% 17-16.10.24	RU000A0JXQF2	50 000 000.00 (Forderungen)	USD 622 255.63

18. Ereignisse nach dem Stichtag

Mit Wirkung zum 03.07.2023 wurde der JSS Investmentfonds II - Sustainable Bond - Asia Opportunities mit dem JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG zusammengelegt.

Im Oktober 2022 gaben CACEIS und Royal Bank of Canada (RBC) bekannt, dass sie eine Absichtserklärung für die beabsichtigte Übernahme des europäischen Asset Servicing Geschäfts von RBC durch CACEIS unterzeichnet haben. Im Rahmen dieser Übernahme würde CACEIS das gesamte ausgegebene Anteilskapital von RBC Investor Services Bank S.A. (IS Bank) erwerben.

Der Verkauf der IS Bank erfolgte nach der Genehmigung durch die Aufsichtsbehörden am 03.07.2023, und RBC Investor Services Bank S.A. wurde zu CACEIS Investor Services Bank S.A.

Zum Datum dieses Abschlusses kommt der Fonds (einschließlich betroffener Teilfonds) weiterhin seinen Verpflichtungen bei Fälligkeit nach und wendet daher bei der Erstellung des Jahresabschlusses weiterhin den Grundsatz der Unternehmensfortführung an. Seit Ende des Geschäftsjahres sind keine weiteren Ereignisse eingetreten, die sich auf den Fonds ausgewirkt haben.

Sonstige ungeprüfte Informationen

Risikomanagementverfahren

Die Verwaltungsgesellschaft verwendet für die Gesellschaft und jeden Teilfonds ein Risikomanagementverfahren im Einklang mit dem Gesetz von 2010 und sonstigen anwendbaren Vorschriften, insbesondere dem Rundschreiben 11/512 der CSSF (Commission de Surveillance du Secteur Financier).

Risikomessmethode - Commitment-Ansatz

Im Rahmen des Risikomanagementverfahrens wird das Gesamtrisiko folgender Teilfondsvermögen durch den Commitment-Ansatz gemessen und kontrolliert:

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets
JSS Sustainable Equity - Global Dividend
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond
JSS Sustainable Equity - Global Thematic
JSS Sustainable Bond - Global Short-term
JSS Sustainable Bond CHF
JSS Sustainable Bond - Euro Broad
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates
JSS Sustainable Green Bond - Global
JSS Sustainable Equity - Europe
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global
JSS Sustainable Equity - USA
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities
JSS Sustainable Equity - Green Planet
JSS Bond - USD High Yield
JSS Sustainable Bond - Total Return Global
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors
JSS Equity - All China

Risikomessmethode - Value-at-Risk / (VaR)-Ansatz

JSS Bond - Emerging Markets Local Currency: absoluter VaR-Ansatz. Folgende Werte wurden für das Geschäftsjahr gemessen (ungeprüft):

Minimum VaR:	4.85%
Durchschnittlicher VaR:	7.68%
Maximum VaR:	11.33%
Mindest-Hebelwirkung:	19.58%
Durchschn. Hebelwirkung:	27.44%
Maximale Hebelwirkung:	46.16%

Die Berechnung des Value-at-Risk erfolgt aufgrund folgender Standards:

Monte-Carlo-Simulation;
einseitiges Konfidenzintervall von 99%;
Halteperiode, die einem Monat entspricht (20 Tage);
effektiver Betrachtungszeitraum (historisch) der Risikofaktoren von einem Jahr (250 Tage);
tägliche Aktualisierung der Daten, wöchentliche Berechnung der Korrelationsmatrix;
(unter RiskMetrics, was per 2. Januar 2019 implementiert wurde, erfolgt die Aktualisierung der vorgenannten Matrix täglich);
tägliche Berechnung entsprechend der NIW-Frequenz.

Die Berechnung der Hebelwirkung erfolgt aufgrund der Summe der Kontraktgrößen.

Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte Verordnung (EU 2015/2365)

Im Geschäftsjahr, auf das sich dieser Bericht bezieht, hat sich die Gesellschaft nicht an Geschäften beteiligt, die der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung unterliegen. Dementsprechend sind keine Gesamt-, Konzentrations- oder Transaktionsdaten oder Angaben zur Weiterverwendung oder zur Verwahrung von Sicherheiten zu berichten.

Sonstige ungeprüfte Informationen (Fortsetzung)

Erklärung zur Vergütungspolitik

Als Verwaltungsgesellschaft des Fonds hat die J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. eine Vergütungspolitik eingeführt, die den Anforderungen des geänderten Gesetzes vom 17.12.2010 betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner geänderten Fassung entspricht. Das Vergütungssystem ist so ausgelegt, dass es in Einklang mit einem soliden und effektiven Risikomanagement steht, sodass es weder zum Eingehen von Risiken ermutigt, die nicht den Risikoprofilen, den vertraglichen Bestimmungen oder den Satzungen der verwalteten Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) entsprechen, noch verhindert, dass die J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. im besten Interesse der OGAW handelt.

Die Vergütungspolitik steht in Einklang mit der Geschäftsstrategie sowie den Zielen, Werten und Interessen der J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. und der Anleger der von ihr verwalteten OGAW und beinhaltet ferner Maßnahmen zur Vermeidung von Interessenkonflikten.

Außertarifliche Mitarbeiter unterliegen der Vergütungspolitik für außertarifliche Mitarbeiter der J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. Die Vergütung von außertariflichen Mitarbeitern setzt sich aus einem angemessenen jährlichen Fixbetrag und einem variablen leistungs-/ergebnisabhängigen Betrag zusammen. Die Gesamtvergütung außertariflicher Mitarbeiter basiert auf nachhaltigen, quantitativen und qualitativen Kriterien der Leistungsbeurteilung, die so objektiv wie möglich sind, unter Berücksichtigung der inhärenten Risiken und abgestuft nach Verantwortung und bekleideter Position. Je höher der Anteil der variablen Vergütung an der Gesamtvergütung ist, desto größer ist der Einfluss auf das operative Geschäft und die Risikotrends. Die quantitativen und qualitativen Kriterien der Leistungsbeurteilung werden auf die verschiedenen Aufgaben der Mitarbeiter und die verschiedenen Situationen, die im jeweiligen Leistungsbeurteilungszeitraum vorliegen, abgestimmt.

Identifizierte Mitarbeiter unterliegen der Vergütungspolitik für identifizierte Mitarbeiter der J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. Die Vergütung von identifizierten Mitarbeitern setzt sich aus einem angemessenen jährlichen Fixbetrag und einem variablen leistungs-/ergebnisabhängigen Betrag zusammen. Die Gesamtvergütung identifizierter Mitarbeiter basiert auf nachhaltigen, quantitativen und qualitativen Kriterien der Leistungsbeurteilung, die so objektiv wie möglich sind, unter Berücksichtigung der inhärenten Risiken und abgestuft nach Verantwortung und bekleideter Position. Je höher der Anteil der variablen Vergütung an der Gesamtvergütung ist, desto größer ist der Einfluss auf das operative Geschäft und die Risikotrends. Die quantitativen und qualitativen Kriterien der Leistungsbeurteilung werden auf die verschiedenen Aufgaben der Mitarbeiter und die verschiedenen Situationen, die im jeweiligen Leistungsbeurteilungszeitraum vorliegen, abgestimmt.

Die Gesamtvergütung für das Jahr zum 31.12.2022 für die Mitarbeiter der J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. in Bezug auf die OGAW beläuft sich auf 642 006 EUR.

Dieser Betrag setzt sich wie folgt zusammen:

Fixe Vergütung:	EUR 584 115
Variable Vergütung:	EUR 57 891
Anzahl der Mitarbeiter:	12

Der Gesamtbetrag der Vergütung, aufgeschlüsselt nach Mitgliedern der Geschäftsleitung und Mitarbeitern der Verwaltungsgesellschaft, deren Handlungen wesentliche Auswirkungen auf das Risikoprofil der OGAW haben, stellt sich wie folgt dar:

Mitglieder der Geschäftsleitung:	EUR 364 802
Mitarbeiter:	EUR 277 204

Die genannten Zahlen repräsentieren den Teil der Vergütung, den J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. nach Aufwand für die OGAW gewichtet an seine Mitarbeiter zahlt.

Nähere Einzelheiten zur Vergütungspolitik können kostenlos von der Website www.jsafrasarasin.com heruntergeladen werden.

Der Compliance-Officer prüft jährlich, ob die Vergütungspolitik ordnungsgemäß umgesetzt wurde. Für das Geschäftsjahr zum 31.12.2022 wurden keine Unregelmäßigkeiten festgestellt.

Es gab im Geschäftsjahr zum 31.12.2022 keine wesentlichen Änderungen der Vergütungspolitik.

Steuerhinweis für JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets

Dieser Teilfonds ist aus steuerlicher Sicht für in Deutschland ansässige Anleger nicht geeignet.

Informationen für Anleger in der Schweiz

Der Vertreter in der Schweiz ist J. Safra Sarasin Investmentfonds AG, Wallstrasse 9, CH-4002 Basel. Die Zahlstelle in der Schweiz ist Bank J. Safra Sarasin Ltd, Elisabethenstrasse 62, CH-4002 Basel. Der Prospekt und die KIIDs, die Satzung sowie die Jahres- und Halbjahresberichte sind kostenlos beim Vertreter und bei allen Vertriebsstellen erhältlich und auch auf der Website www.jsafrasarasin.ch/funds verfügbar.

Zusätzliche Informationen für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland.

Die Gesellschaft hat die Absicht, Investmentanteile zu vertreiben, der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) in Bonn angezeigt und ist seit Abschluss des Anzeigeverfahrens zum Vertrieb berechtigt.

Sonstige ungeprüfte Informationen (Fortsetzung)

Vertriebs- und Informationsstelle in Deutschland

J. Safra Sarasin (Deutschland) GmbH
Taunusanlage 17
D-60325 Frankfurt am Main

hat in Deutschland die Funktion der Vertriebs- und Informationsstelle (die „deutsche Vertriebs- und Informationsstelle“) übernommen.

Die deutsche Vertriebs- und Informationsstelle führt ein Zahlstellenkonto, auf das Anleger Einzahlungen in Euro per Überweisung, Scheck oder im Rahmen der gesetzlichen Vorschriften in bar leisten können. Die deutsche Vertriebs- und Informationsstelle sendet die Anlagebeträge nach Gutschrift auf dem Zahlstellenkonto umgehend mittels SWIFT auf das Konto der Verwahrstelle des JSS Investmentfonds unter Angabe des entsprechenden Teilfonds.

Rücknahme- und Umtauschanträge für die Aktien können bei der deutschen Vertriebs- und Informationsstelle zur Weiterleitung an die Gesellschaft eingereicht werden. Aktionäre können verlangen, dass alle Zahlungen (Erlöse aus Rücknahmen, Ausschüttungen und sonstige Zahlungen) über die deutsche Vertriebs- und Informationsstelle geleistet werden.

Vertriebs- und Informationsstelle in Deutschland

Bei der deutschen Vertriebs- und Informationsstelle sind der Verkaufsprospekt und die wesentlichen Anlegerinformationen (KIIDs), die Satzung der Gesellschaft, der Jahresbericht der Gesellschaft einschließlich des geprüften Abschlusses und der ungeprüfte Halbjahresbericht kostenlos als Druckstücke sowie etwaige Mitteilungen an die Anleger und die Ausgabe-, Rücknahme- und Umtauschpreise, Zwischengewinne und ausschüttungsgleichen Erträge der Aktien erhältlich.

Eine Liste der Veränderungen im Portfolio ist außerdem bei der Vertriebs- und Informationsstelle in Deutschland kostenfrei erhältlich.

Darüber hinaus können während der üblichen Geschäftszeiten bei der deutschen Vertriebs- und Informationsstelle das Management Company Agreement, das Depositary and Paying Agency Agreement sowie das Investment Fund Service Agreement eingesehen werden.

Aktienpreis- und sonstige Veröffentlichungen

Die Ausgabe-, Rücknahme- und Umtauschpreise für alle Teilfonds werden auf www.jsafrasarasin.ch/funds veröffentlicht. Etwaige Mitteilungen an die Anleger erfolgen in der Bundesrepublik Deutschland auf www.jsafrasarasin.ch/funds.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Unternehmenskennung (LEI-Code):

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG

549300KODVGM5FYQ564

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

X Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 69 % an nachhaltigen Investitionen.

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 41 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating und 46 % der Anlagen des Produkts ein B-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 6,98 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,
die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 6,98 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x			Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3). In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.
2	CO ₂ -Fußabdruck	x	x			
3	THG-Emissionsintensität	x	x			
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x			
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x			
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x			
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.
8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

					Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x			JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.				Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x	JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.
13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x	JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x			JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen					
15	THG-Emissionsintensität		x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen		x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
TSMC ARIZON 2,50 % 21-25.10.31	USA	Beteiligungsgesellschaften	1,10 %
AMER MOVIL 3,625 % 19-22.04.29	MX	Drahtlose Telekommunikation	0,95 %
CENCOSUD 5,15 % 15-12.02.25	CL	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorädern	0,83 %
BK LEUMI 5,125 % 22-27.07.27	IL	Sonstige Kreditinstitute	0,79 %
SANTANDER 5,375 % 20-17.4.25 REGS	MX	Sonstige Kreditinstitute	0,79 %
INVERSIONES 4,75 % 14-15.09.24	CL	Herstellung von Papier und Papierprodukten	0,79 %
KOREAREHABN 4,125 % 22-20.04.27	KR	Vermittlung von Wertpapieren und Waretermingeschäften	0,76 %
BBL TB 9,025 % 97-15.3.29	HK	Central Banking	0,75 %
EMPRESA NAC 3,75 % 16-05.08.26	CL	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorädern	0,75 %
BDO UNIBANK 2,125 % 20-13.01.26	PH	Sonstige Kreditinstitute	0,73 %
RAS LAFF 3 5,838 % 30.927/POOL	QA	Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,72 %
DP WORLD 6,85 % 07-2.7.37	AE	Wassertransport	0,72 %
BK LEUMI 3,275 % 20-29.01.31	IL	Sonstige Kreditinstitute	0,70 %
CK HUTCHISO 2,50 % 08.05.30 REGS	KY	Beteiligungsgesellschaften	0,68 %
SOUTH AFRICA 4,665 % 12-17.1.24	ZA	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	0,66 %



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 69 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 35 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 34 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 88 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 69 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 35 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 34 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 19 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 12 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Gastgewerbe	Gastgewerbe	1,59 %
Sonstige wirtschaftliche Dienstleistungen	Sonstige geschäftliche Unterstützungsdienstleistungen a. n. g.	1,33 %
Kunst, Unterhaltung und Erholung	Spiel-, Wett- und Lotteriewesen	0,21 %
Baugewerbe	Tiefbau	0,31 %
	Bau von Versorgungsprojekten für Strom und Telekommunikation	0,78 %
Energieversorgung	Energieversorgung	4,41 %
	Stromerzeugung	0,74 %
	Übertragung von Elektrizität	0,39 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	7,73 %
	Central Banking	4,70 %
	Finanzierungsleasing	4,00 %
	Fondsmanagementaktivitäten	0,35 %
	Lebensversicherung	2,04 %
	Nichtlebensversicherung	0,44 %
	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	0,65 %
	Sonstige Kreditinstitute	0,68 %
	Sonstige Finanzdienstleistungen, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds a. n. g.	0,61 %
	Sonstige Kreditinstitute	21,42 %
	Immobilienaktivitäten	2,16 %
	Vermittlung von Wertpapieren und Waretermingeschäften	0,74 %
	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	2,41 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Information und Kommunikation	Sonstiges Verlagswesen	1,22 %
	Programm- und Sendetätigkeit	1,18 %
	Telekommunikation	1,93 %
	Webportale	1,90 %
	Kabelgebundene Telekommunikation	0,38 %
	Drahtlose Telekommunikation	2,05 %
Herstellung	Herstellung von Grundmetallen	0,56 %
	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	1,15 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	1,47 %
	Herstellung von Düngemitteln und Stickstoffverbindungen	0,53 %
	Herstellung von Lebensmittelprodukten	1,45 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	2,37 %
	Herstellung	3,57 %
	Edelmetallproduktion	0,73 %
Bergbau und Steinbruch	Gewinnung von Erdöl	1,12 %
	Gewinnung von Erdöl und Erdgas	3,25 %
	Abbau von Metallerzen	0,39 %
	Abbau von sonstigen Nichteisenmetallerzen	0,39 %
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	Allgemeine öffentliche Verwaltung	0,53 %
	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	7,96 %
Verkehr und Lagerei	Lufttransport	0,32 %
	Landtransport und Transport in Rohrfernleitungen	0,29 %
	Verkehr und Lagerei	1,50 %
	Wassertransport	0,72 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	1,84 %
	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	3,91 %
	Großhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	0,49 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 18 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

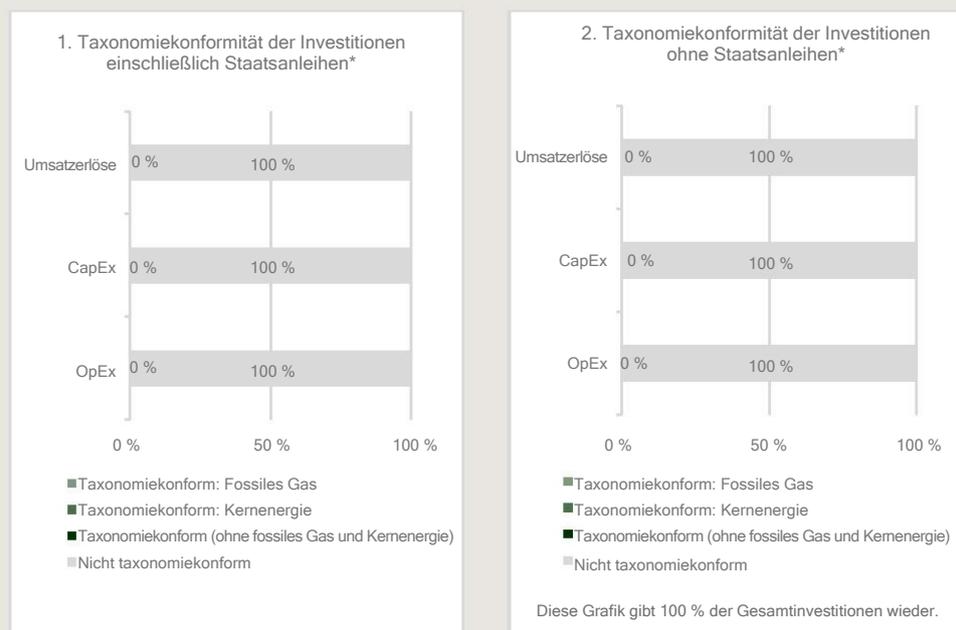
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 35 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 34 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart. Ebenfalls berücksichtigt wurden Investitionen, die aufgrund unzureichender Daten nicht als an den ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet bewertet werden können. Als Mindestschutz entsprechen diese Investitionen der JSS-Ausschlussrichtlinie und überschreiten nicht die definierten Umsatzschwellen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

- (a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie;
- (b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;
- (c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert;
- (d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300J3PHJIR55QQ170

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 90 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 100 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 5,04 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,
die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 5,04 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x		x	<p>Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3). In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien. Im Mai 2020 startete JSS ein Klimaversprechen mit dem Ziel, bis 2035 einen CO₂-neutralen Ausgang zu erreichen. Kontrollen der THG-Emissionen werden anhand des CO₂-Fußabdrucks durchgeführt und gelten für eine Untergruppe von Fonds. Das Klimaversprechen wird für die nachhaltigen Anlagestrategien umgesetzt und durch den rückwärts gerichteten Dekarbonisierungspfad verfolgt, um Übergangsrisiken zu mindern. Die Methodik definiert die Zielsetzung als eine Reduzierung</p>
2	CO ₂ -Fußabdruck	x	x		x	
3	THG-Emissionsintensität	x	x		x	
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x		x	
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x		x	
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x		x	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

						des THG-Emissionen-Fußabdrucks der Benchmark um 30 %, der in den folgenden Jahren um 7 % reduziert wird. Ab 2030 reduziert sich das Ziel linear bis zum Erreichen von Netto-Null in 2035. Die THG-Emissionen des Portfolios auf Basis der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO2e pro USD Mio. EVIC ausgedrückt.
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.
8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Nebenprodukte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

						integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle					Derzeit für dieses Produkt nicht bewertet. JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.
13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen					Derzeit für dieses Produkt nicht bewertet. JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACT	TW	Herstellung von elektronischen Komponenten	6,93 %
TENCENT HOLDINGS LTD	KY	Sonstiges Verlagswesen	4,77 %
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	KR	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	4,21 %
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	KY	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	3,39 %
MEITUAN	KY	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	2,03 %
ASIAN PAINTS	IN	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	1,69 %
PING AN INSUR.(GRP)CO -H-	KN	Bildung	1,69 %
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	KR	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	1,49 %
HOUSING DEVT FIN CORP	IN	Sonstige Kreditinstitute	1,38 %
LG CHEM LTD /PFD SHS /I01	KR	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	1,35 %
LG CHEMICAL LTD	KR	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	1,31 %
JD.COM RG-A	KY	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	1,20 %
WEG SA	BR	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	1,02 %
SK HYNIX INC	KR	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	0,95 %
INFOSYS -- SHS	IN	IT-Beratungstätigkeiten	0,93 %



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

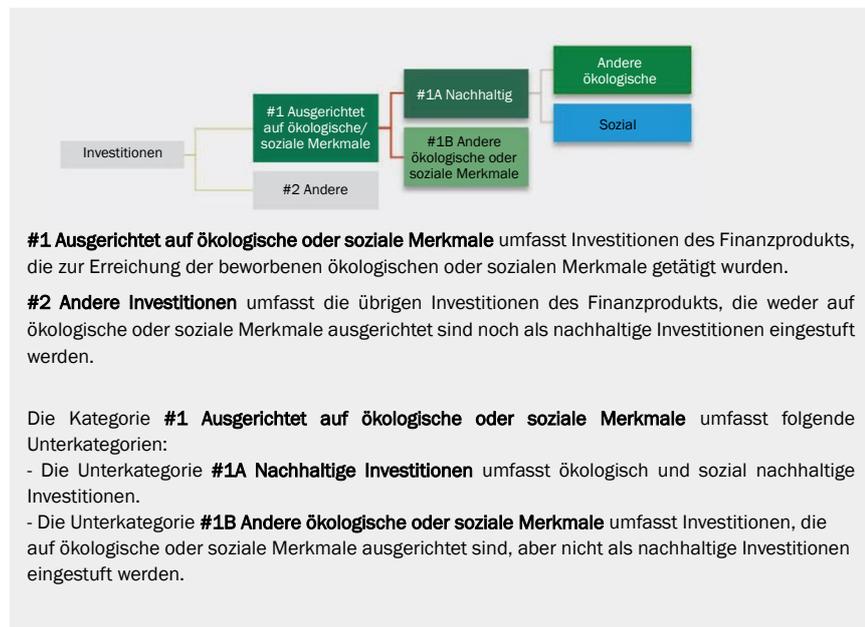
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 90 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 41 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 49 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 96 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 90 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 41 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 49 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 6 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 4 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	Abfallsammlung, -Behandlung und -Entsorgung; Materialrückgewinnung	0,47 %
	Wassergewinnung, -aufbereitung und -versorgung	0,55 %
Gastgewerbe	Gastronomie	0,99 %
Baugewerbe	Tiefbau	1,42 %
Bildung	Bildung	1,08 %
Energieversorgung	Stromverteilung	0,58 %
	Energieversorgung	1,32 %
	Stromerzeugung	0,20 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	0,57 %
	Verwaltung der Finanzmärkte	0,52 %
	Central Banking	0,50 %
	Finanzierungsleasing	1,17 %
	Lebensversicherung	2,41 %
	Nichtlebensversicherung	2,19 %
	Sonstige Kreditinstitute	2,48 %
	Sonstige Kreditinstitute	5,99 %
	Immobilienaktivitäten	3,11 %
	Vermittlung von Wertpapieren und Warendermingeschäften	1,51 %
	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	0,47 %
Gesundheits- und Sozialwesen	Tätigkeiten im Gesundheitswesen	0,66 %
	Sonstige Tätigkeiten im Gesundheitswesen	0,43 %
Information und Kommunikation	IT-Beratungstätigkeiten	1,55 %
	Computerprogrammierungstätigkeiten	0,99 %
	Informationsdienste	0,52 %
	Sonstiges Verlagswesen	5,05 %
	Sonstige Softwareveröffentlichung	0,37 %
	Programm- und Sendetätigkeit	0,63 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

	Verlagsaktivitäten	1,53 %
	Webportale	0,95 %
Herstellung	Herstellung von Erfrischungsgetränken; Gewinnung natürlicher Mineralwasser und Herstellung von sonstigem abgefülltem Wasser	0,64 %
	Herstellung von Grundmetallen	0,44 %
	Herstellung von pharmazeutischen Grundstoffen und pharmazeutischen Präparaten	1,79 %
	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	7,05 %
	Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	0,61 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	7,71 %
	Herstellung von elektrischen Geräten	1,38 %
	Herstellung von elektronischen Komponenten	6,48 %
	Herstellung von Schmuck, Gold- und Silberschmiedewaren (ohne Fantasieschmuck)	0,60 %
	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	0,89 %
	Herstellung von Kraftfahrzeugen	0,64 %
	Herstellung von Kraftwagen, Anhängern und Sattelanhängern	1,02 %
	Herstellung von sonstigen elektronischen und elektrischen Drähten und Kabeln	0,41 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	1,61 %
	Herstellung von Körperpflegemitteln und Duftstoffen	1,12 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	0,43 %
	Herstellung von Gummi- und Kunststoffprodukten	0,50 %
	Herstellung	5,44 %
	Milchverarbeitung	0,72 %
	Andere Fertigung	0,49 %
Bergbau und Steinbruch	Bergbau und Steinbruch	0,68 %
	Abbau von sonstigen Nichteisenmetallerzen	0,38 %
	Bergbauunterstützungsdienstleistungen	0,51 %
Sonstige Dienstleistungen	Sonstige Dienstleistungen	0,44 %
Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	1,98 %
	Forschung und Entwicklung im Bereich Biotechnologie	0,75 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	6,42 %
	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	3,86 %
	Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	0,93 %
	Großhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	0,51 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 8 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

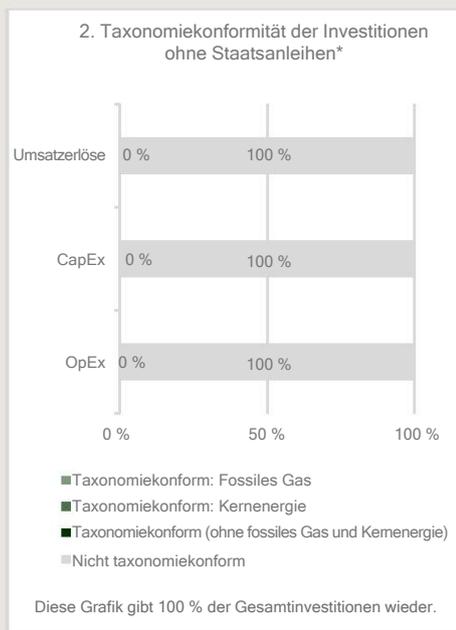
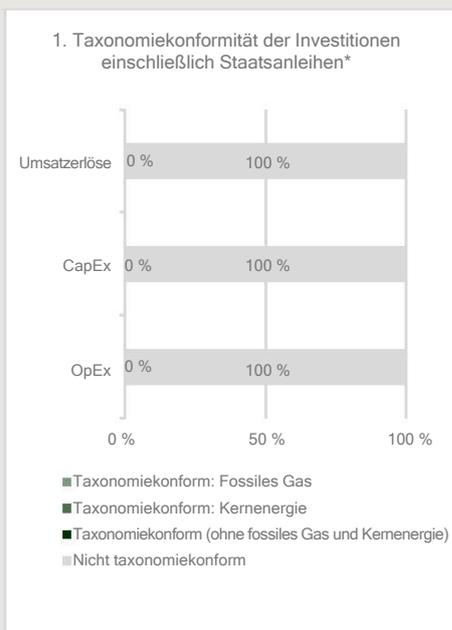
Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**
Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 41 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 49 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

- (a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie;
- (b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;
- (c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert;
- (d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Während des Berichtszeitraums befanden sich die Unternehmen des Produkts, in die investiert wird, nicht im Bereich der Mitwirkungsaktivitäten des Anlageverwalters.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Equity - Global Dividend

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300854K0PYVIM6U93

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 96 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 85 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating und 15 % der Anlagen des Produkts ein B-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 4,18 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),

die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,

die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,

die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 4,18 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x			Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3). In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.
2	CO ₂ -Fußabdruck	x	x			
3	THG-Emissionsintensität	x	x			
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x			
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x			
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x			
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

						Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.
8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Nebenprodukte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

						Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.
13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
MCDONALD S CORP.	USA	Gastronomie und mobile Gastronomie	4,16 %
CME GROUP INC	USA	Verwaltung der Finanzmärkte	4,03 %
DARDEN RESTAURANTS	USA	Gastronomie	4,00 %
PEPSICO INC	USA	Herstellung von Erfrischungsgetränken; Gewinnung natürlicher Mineralwasser und Herstellung von sonstigem abgefülltem Wasser	3,96 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

TEXAS INSTRUMENTS INC	USA	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	3,93 %
ROYAL BANK OF CANADA	CA	Sonstige Kreditinstitute	3,78 %
BRISTOL MYERS SQUIBB CO	USA	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	3,77 %
PROCTER & GAMBLE CO.	USA	Herstellung von Seifen, Wasch-, Reinigungs- und Poliermitteln	3,74 %
EMERSON ELECTRIC CO.	USA	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	3,68 %
PACCAR INC.	USA	Herstellung von Kraftwagen, Anhängern und Sattelanhängern	3,58 %
HOME DEPOT INC.	USA	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	3,50 %
MERCK	USA	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	3,44 %
UTD PARCEL SERVICE INC -B-	USA	Post-, Kurier- und Expressdienste	3,38 %
JOHNSON & JOHNSON	USA	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	3,12 %
IBM CORP	USA	IT-Beratungstätigkeiten	3,11 %



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 96 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 49 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 47 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 98 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 96 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 49 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 47 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 2 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 2 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Gastgewerbe	Gastronomie	6,04 %
	Gastronomie und mobile Gastronomie	3,93 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	1,52 %
	Verwaltung der Finanzmärkte	3,71 %
	Lebensversicherung	3,61 %
	Nichtlebensversicherung	2,16 %
	Sonstige Kreditinstitute	5,94 %
Information und Kommunikation	IT-Beratungstätigkeiten	3,39 %
	Drahtlose Telekommunikation	2,70 %
Herstellung	Herstellung, Runderneuerung und Reparatur von Bereifungen	1,33 %
	Herstellung von Erfrischungsgetränken; Gewinnung natürlicher Mineralwasser und Herstellung von sonstigem abgefülltem Wasser	3,39 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	8,70 %
	Herstellung von Lebensmittelprodukten	1,46 %
	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	7,13 %
	Herstellung von Kraftwagen, Anhängern und Sattelanhängern	3,93 %
	Herstellung von Papier und Karton	1,01 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	16,10 %
	Mineralölverarbeitung	1,49 %
	Herstellung von Seifen, Wasch-, Reinigungs- und Poliermitteln	3,58 %
	Herstellung von Verdrahtungsgeräten	1,65 %
	Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Sonstige Forschung und experimentelle Entwicklung in den Bereichen Naturwissenschaften und Ingenieurwesen
Verkehr und Lagerei	Postdienstleistungen im Rahmen universeller Dienstleistungsverpflichtung	1,16 %
	Post-, Kurier- und Expressdienste	3,12 %
	Lagerhaltung und unterstützende Aktivitäten für den Transport	1,49 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandel in nicht spezialisierten Geschäften, in denen Lebensmittel, Getränke oder Tabak überwiegen	1,52 %
	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	6,18 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 5 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

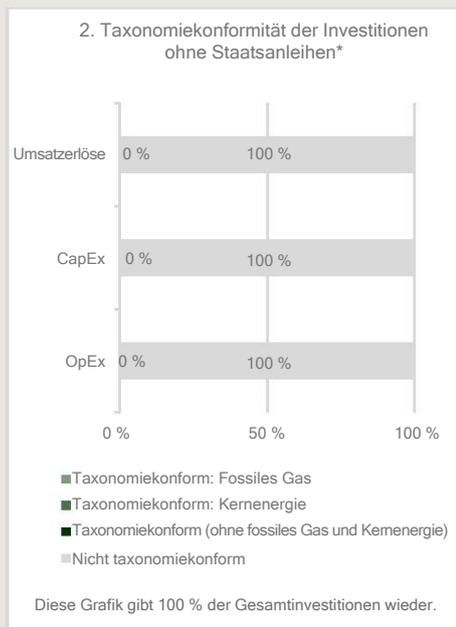
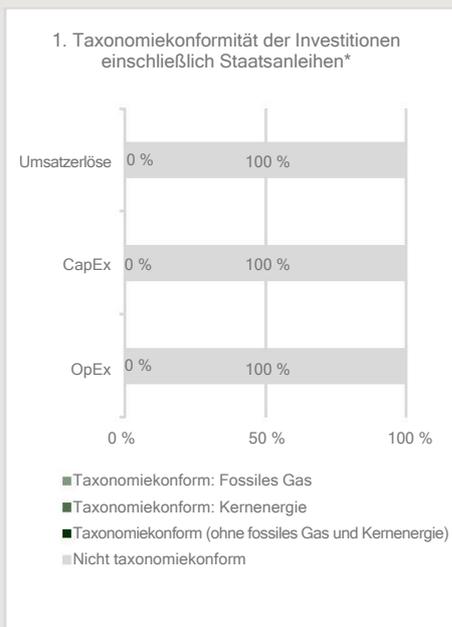
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**
Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 49 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 47 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

- (a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie;
- (b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;
- (c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert;
- (d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493002QQC13UGTJE062

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 88 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 94 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating und 5 % der Anlagen des Produkts ein B-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 1,89 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,
die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 1,89 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x			Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3). In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.
2	CO ₂ -Fußabdruck	x	x			
3	THG-Emissionsintensität	x	x			
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x			
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x			
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x			
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

						Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.
8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

12	Unbereinigtes geschlechts-spezifisches Verdienst-gefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.
13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
GERMANY 4,75 % 98-04.07.28	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	4,83 %
GERMANY 4,75 % 03-04.07.34	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	4,30 %
GERMANY 5,5 % 00-04.01.31	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	3,36 %
GERMANY 4,25 % 07-04.07.39	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	2,93 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 01.07.2022 – 30.06.2023

FRANCE 2,25 % 13-25.05.24 /OAT	FR	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,59 %
MICROSOFT CORP.	USA	Sonstige Softwareveröffentlichung	2,35 %
AMAZON COM INC	USA	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	2,34 %
GERMANY 2 % 13-15.08.23	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	2,11 %
AIA GROUP LTD	HK	Lebensversicherung	2,03 %
FRANCE 2,75 % 25.10.27 OAT REGS	FR	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,92 %
MASTERCARD INC. SHS-A-	USA	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	1,75 %
QUAER C ARGON -B-EUR/CAP	LU	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	1,53 %
MERCK	USA	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	1,50 %
CME GROUP INC	USA	Verwaltung der Finanzmärkte	1,48 %
SPAIN 5,9 % 11-30.7.26	ES	Allgemeine öffentliche Verwaltung	1,39 %



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 88 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 42 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 46 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 98 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 88 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 42 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 46 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 10 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 2 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %	
Gastgewerbe	Gastronomie	1,38 %	
Aktivitäten extrritorialer Organisationen und Körperschaften	Aktivitäten extrritorialer Organisationen und Körperschaften	0,51 %	
Energieversorgung	Stromverteilung	0,51 %	
	Stromerzeugung	0,23 %	
	Handel mit Elektrizität	0,78 %	
	Übertragung von Elektrizität	1,17 %	
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	1,26 %	
	Verwaltung der Finanzmärkte	3,12 %	
	Finanzierungsleasing	0,91 %	
	Lebensversicherung	3,11 %	
	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	1,43 %	
	Sonstige Kreditinstitute	1,37 %	
	Sonstige Finanzdienstleistungen, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds a. n. g.	1,04 %	
	Sonstige Kreditinstitute	5,98 %	
	Immobilienaktivitäten	0,55 %	
	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	3,06 %	
	Information und Kommunikation	IT-Beratungstätigkeiten	0,81 %
		Computerprogrammierungstätigkeiten	1,14 %
		Sonstiges Verlagswesen	1,21 %
Sonstige Softwareveröffentlichung		2,17 %	
Verlagsaktivitäten		1,05 %	
Satellitenkommunikation		0,56 %	
Fernsehsendungen und Rundfunk		0,68 %	
Webportale		2,58 %	
Kabelgebundene Telekommunikation		0,45 %	
Drahtlose Telekommunikation		0,75 %	
Herstellung		Herstellung von Land- und Forstmaschinen	0,85 %
		Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	1,47 %
		Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	1,37 %
	Herstellung von elektronischen Komponenten	1,84 %	
	Herstellung von Motoren und Turbinen, außer Motoren für Flugzeuge, Fahrzeuge und Fahrräder	0,73 %	
	Herstellung von Mess-, Kontroll-, Navigations- und ähnlichen Instrumenten und Vorrichtungen	0,99 %	
	Herstellung von Bestrahlungsgeräten, elektromedizinischen und elektrotherapeutischen Geräten	0,15 %	
	Herstellung von Hebezeugen und Fördermitteln	1,02 %	
	Herstellung von Koffern, Taschen und ähnliche Waren, und Sattlerwaren	1,12 %	
	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	0,81 %	
	Herstellung von medizinischen und zahnmedizinischen Apparaten und Materialien	0,70 %	
	Herstellung von sonstigen chemischen Produkten a. n. g.	0,82 %	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

	Herstellung von sonstigen elektrischen Geräten	0,81 %
	Herstellung von sonstigen Sondermaschinen a. n. g.	1,42 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	4,49 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	2,72 %
	Herstellung von Seifen, Wasch-, Reinigungs- und Poliermitteln	1,23 %
	Andere Fertigung	1,64 %
Bergbau und Steinbruch	Gewinnung von Erdöl und Erdgas	1,08 %
Sonstige Dienstleistungen	Bestattung und damit verbundene Tätigkeiten	0,85 %
Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Ingenieurbüros	0,67 %
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	Allgemeine öffentliche Verwaltung	23,17 %
	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	7,56 %
Verkehr und Lagerei	Dienstleistungen für den Luftverkehr	1,04 %
	Transport in Rohrfernleitungen	0,60 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	2,58 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 4 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

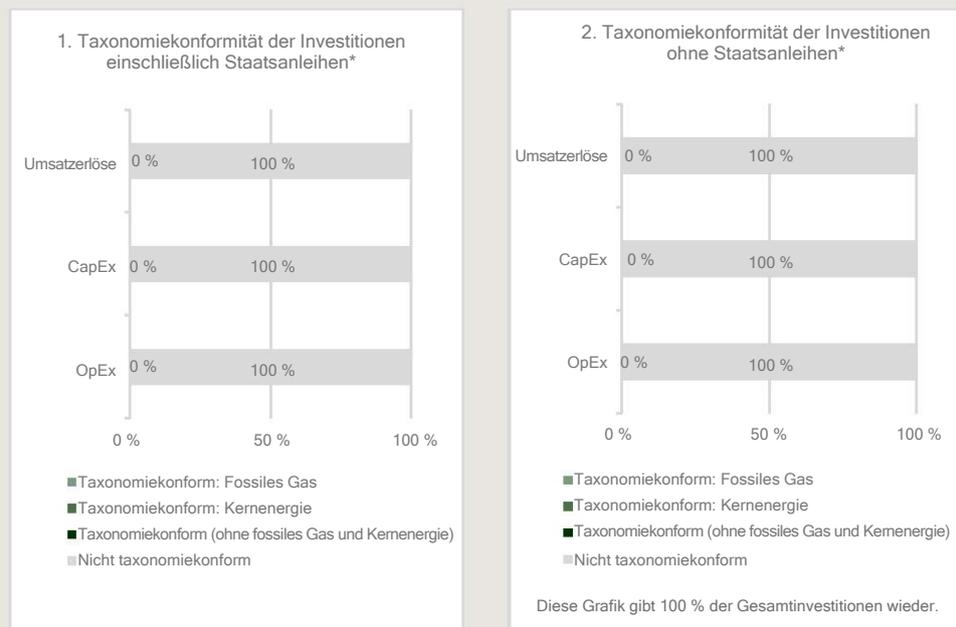
Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 42 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 46 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart. Ebenfalls berücksichtigt wurden Investitionen, die aufgrund unzureichender Daten nicht als an den ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet bewertet werden können. Als Mindestschutz entsprechen diese Investitionen der JSS-Ausschlussrichtlinie und überschreiten nicht die definierten Umsatzschwellen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts verfolgte einen strikten Prozess, bei dem ESG-Aspekte integriert wurden. Der Anlageprozess des Anlageverwalters umfasste zwei wichtige ESG-Aspekte.

Das erste wichtige Element der Anlagestrategie, das zur Auswahl der Anlagen verwendet wurde, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, war die Analyse der bedeutenden nicht nachhaltigen Aktivitäten des Unternehmens, die anhand der proprietären Sarasin Sustainability Impact Matrix (SSIM) des Anlageverwalters identifiziert wurden.

Das zweite wichtige Element war die Strategie des Engagements und der Abstimmung, um das Unternehmen zum Übergang zu einem nachhaltigeren Ansatz zu bewegen. Die Zeiträume für einen Übergang variieren, aber in Fällen, in denen das Unternehmen, in das investiert wurde, als Unternehmen mit hohem Klimarisiko eingestuft wurde und es an einer ausdrücklichen Selbstverpflichtung und einem glaubwürdigen Übergangsplan fehlte, hat der Anlageverwalter direkt mit dem Unternehmen zusammengearbeitet, um es bei der Einführung einer Netto-Null-Strategie zu unterstützen. Unternehmen, die den Übergang nicht geschafft haben, stellen ein erhebliches finanzielles Risiko für die Anteilhaber dar, und ihre Beteiligungen an dem Produkt können schließlich vom Anlageverwalter verkauft werden.

Darüber hinaus wurde ein Bestandsscreening anhand der J. Safra Sustainability Matrix durchgeführt, um die Anwendung eines überdurchschnittlichen Branchen-ESG-Profiles sicherzustellen. Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert, wie in dieser Matrix definiert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493009IXDIFQEFKEV17

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 90 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 94 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating und 5 % der Anlagen des Produkts ein B-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 2,58 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,
die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 2,58 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x			Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.
2	CO ₂ -Fußabdruck	x	x			
3	THG-Emissionsintensität	x	x			In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3).
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x			
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x			
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x			In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

						Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.
8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
GERMANY 4,25 % 07-04.07.39	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	3,73 %
GERMANY 2 % 13-15.08.23	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	3,25 %
GERMANY 4,75 % 03-04.07.34	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	3,16 %
FRANCE 2,75 % 25.10.27 OAT REGS	FR	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,63 %
SPAIN 5,9 % 11-30.7.26	ES	Allgemeine öffentliche Verwaltung	2,36 %
AMAZON COM INC	USA	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	2,32 %
MICROSOFT CORP.	USA	Sonstige Softwareveröffentlichung	2,32 %
AIA GROUP LTD	HK	Lebensversicherung	2,01 %
GERMANY 4,75 % 98-04.07.28	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	1,96 %
GERMANY 5,5 % 00-04.01.31	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	1,82 %
MASTERCARD INC. SHS-A-	USA	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	1,74 %
QUAER C ARGON -B- EUR/CAP	LU	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	1,56 %
MERCK	USA	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	1,49 %
FRANCE 4,75 % 04-25.4.35 OAT	FR	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,49 %
CME GROUP INC	USA	Verwaltung der Finanzmärkte	1,47 %



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

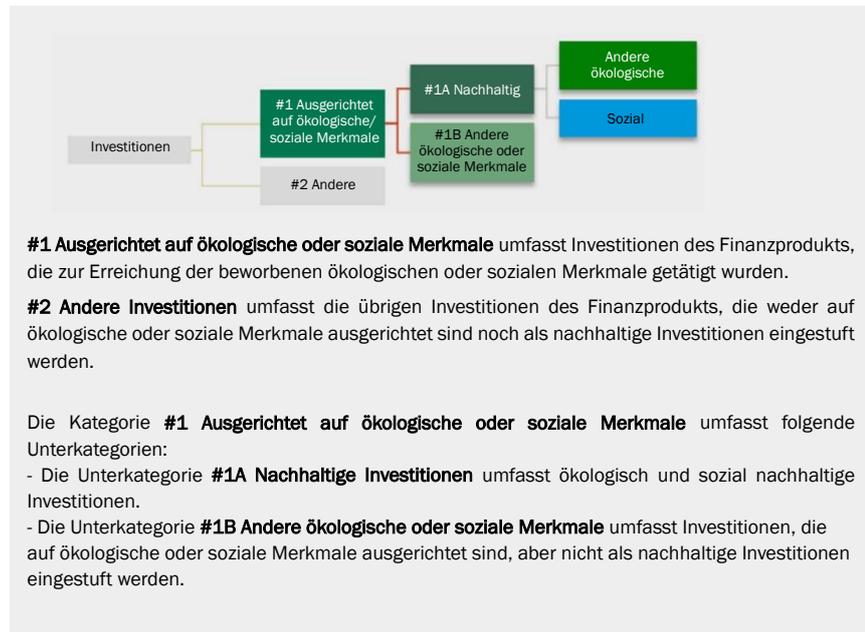
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 90 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 42 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 48 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 97 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 90 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 42 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 48 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 7 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 3 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Gastgewerbe	Gastronomie	1,39 %
Aktivitäten exterritorialer Organisationen und Körperschaften	Aktivitäten exterritorialer Organisationen und Körperschaften	0,47 %
Energieversorgung	Stromverteilung	1,33 %
	Stromerzeugung	0,44 %
	Übertragung von Elektrizität	0,55 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	0,58 %
	Verwaltung der Finanzmärkte	3,17 %
	Finanzierungsleasing	0,49 %
	Lebensversicherung	3,45 %
	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	1,44 %
	Sonstige Kreditinstitute	0,72 %
	Sonstige Finanzdienstleistungen, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds a. n. g.	2,33 %
	Sonstige Kreditinstitute	6,03 %
	Immobilienaktivitäten	0,66 %
	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	3,05 %
Information und Kommunikation	IT-Beratungstätigkeiten	0,81 %
	Computerprogrammierungstätigkeiten	1,15 %
	Sonstiges Verlagswesen	1,21 %
	Sonstige Softwareveröffentlichung	2,18 %
	Verlagsaktivitäten	1,06 %
	Satellitenkommunikation	0,54 %
	Fernsehsendungen und Rundfunk	0,68 %
	Webportale	2,57 %
	Kabelgebundene Telekommunikation	0,33 %
Drahtlose Telekommunikation	1,51 %	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Herstellung	Herstellung von Land- und Forstmaschinen	0,86 %	
	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	1,48 %	
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	1,38 %	
	Herstellung von elektronischen Komponenten	1,83 %	
	Herstellung von Motoren und Turbinen, außer Motoren für Flugzeuge, Fahrzeuge und Fahrräder	0,73 %	
	Herstellung von Mess-, Kontroll-, Navigations- und ähnlichen Instrumenten und Vorrichtungen	0,99 %	
	Herstellung von Bestrahlungsgeräten, elektromedizinischen und elektrotherapeutischen Geräten	0,60 %	
	Herstellung von Hebezeugen und Fördermitteln	1,03 %	
	Herstellung von Koffern, Taschen und ähnliche Waren, und Sattlerwaren	1,13 %	
	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	0,51 %	
	Herstellung von medizinischen und zahnmedizinischen Apparaten und Materialien	0,71 %	
	Herstellung von sonstigen chemischen Produkten a. n. g.	0,83 %	
	Herstellung von sonstigen elektrischen Geräten	0,81 %	
	Herstellung von sonstigen Sondermaschinen a. n. g.	1,43 %	
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	4,51 %	
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	2,85 %	
	Herstellung von Seifen, Wasch-, Reinigungs- und Poliermitteln	1,24 %	
	Andere Fertigung	1,62 %	
	Bergbau und Steinbruch	Gewinnung von Erdöl und Erdgas	1,09 %
	Sonstige Dienstleistungen	Bestattung und damit verbundene Tätigkeiten	0,86 %
Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Ingenieurbüros	0,66 %	
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	Allgemeine öffentliche Verwaltung	21,61 %	
	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	7,77 %	
Verkehr und Lagerei	Personenbeförderungsleistungen im Eisenbahnfernverkehr	0,30 %	
	Dienstleistungen für den Landverkehr	1,07 %	
	Transport in Rohrfernleitungen	0,58 %	
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	2,58 %	

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 4 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

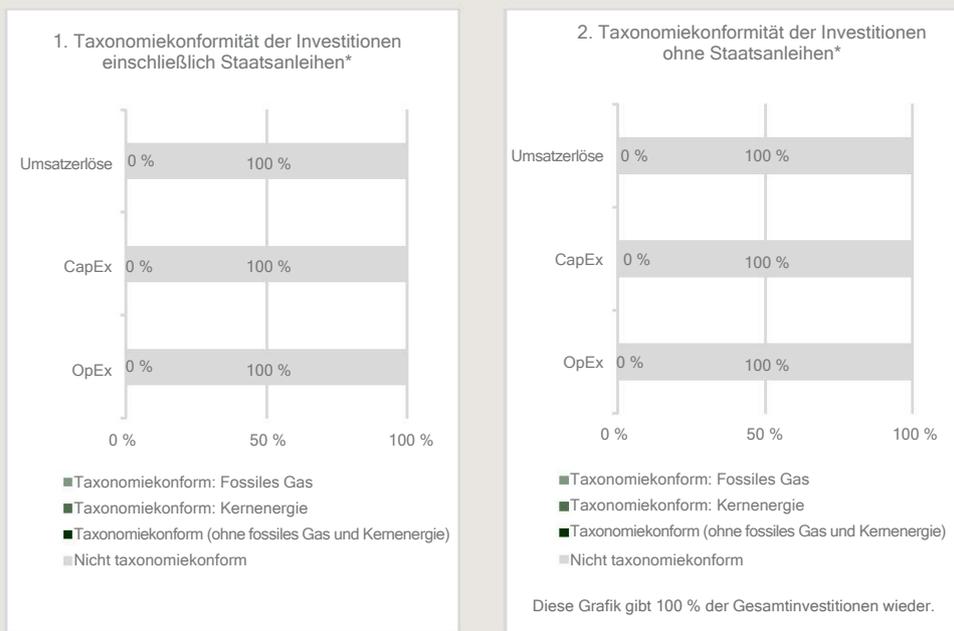
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**
Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 42 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 48 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart. Ebenfalls berücksichtigt wurden Investitionen, die aufgrund unzureichender Daten nicht als an den ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet bewertet werden können. Als Mindestschutz entsprechen diese Investitionen der JSS-Ausschlussrichtlinie und überschreiten nicht die definierten Umsatzschwellen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts verfolgte einen strikten Prozess, bei dem ESG-Aspekte integriert wurden. Der Anlageprozess des Anlageverwalters umfasste zwei wichtige ESG-Aspekte.

Das erste wichtige Element der Anlagestrategie, das zur Auswahl der Anlagen verwendet wurde, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, war die Analyse der bedeutenden nicht nachhaltigen Aktivitäten des Unternehmens, die anhand der proprietären Sarasin Sustainability Impact Matrix (SSIM) des Anlageverwalters identifiziert wurden.

Das zweite wichtige Element war die Strategie des Engagements und der Abstimmung, um das Unternehmen zum Übergang zu einem nachhaltigeren Ansatz zu bewegen. Die Zeiträume für einen Übergang variieren, aber in Fällen, in denen das Unternehmen, in das investiert wurde, als Unternehmen mit hohem Klimarisiko eingestuft wurde und es an einer ausdrücklichen Selbstverpflichtung und einem glaubwürdigen Übergangsplan fehlte, hat der Anlageverwalter direkt mit dem Unternehmen zusammengearbeitet, um es bei der Einführung einer Netto-Null-Strategie zu unterstützen. Unternehmen, die den Übergang nicht geschafft haben, stellen ein erhebliches finanzielles Risiko für die Anteilhaber dar, und ihre Beteiligungen an dem Produkt können schließlich vom Anlageverwalter verkauft werden.

Darüber hinaus wurde ein Bestandsscreening anhand der J. Safra Sustainability Matrix durchgeführt, um die Anwendung eines überdurchschnittlichen Branchen-ESG-Profiles sicherzustellen. Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert, wie in dieser Matrix definiert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend



Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300X6SDDZ1HKVOE31

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 87 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendants in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 96 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating und 3 % der Anlagen des Produkts ein B-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 3,38 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,
die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 3,38 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x			Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3). In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.
2	CO ₂ -Fußabdruck	x	x			
3	THG-Emissionsintensität	x	x			
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x			
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x			
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x			
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

						Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.
8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmen und Aktivitäten im

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

						Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.
13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
AMAZON COM INC	USA	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	3,47 %
MICROSOFT CORP.	USA	Sonstige Softwareveröffentlichung	3,46 %
AIA GROUP LTD	HK	Lebensversicherung	3,03 %
MASTERCARD INC. SHS-A-	USA	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	2,77 %
MERCK	USA	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	2,44 %
QUAER C ARGON -B-EUR/CAP	LU	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	2,31 %
CME GROUP INC	USA	Verwaltung der Finanzmärkte	2,30 %
MEDTRONIC HOLDINGS LIMITED	IE	Andere Fertigung	2,11 %
ALPHABET INC -A-	USA	Webportale	1,99 %

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

ASML HOLDING NV	NL	Herstellung von sonstigen Sondermaschinen a. n. g.	1,97 %
WALT DISNEY	USA	Fernsehsendungen und Rundfunk	1,86 %
SAMSONITE INTERNATIONAL	LU	Herstellung von Koffern, Taschen und ähnliche Waren, und Sattlerwaren	1,85 %
OTIS WORLDWIDE CORPORATION	USA	Herstellung von Hebezeugen und Fördermitteln	1,85 %
TENCENT HOLDINGS LTD	KY	Sonstiges Verlagswesen	1,77 %
ILLUMINA INC	USA	Herstellung von Mess-, Kontroll-, Navigations- und ähnlichen Instrumenten und Vorrichtungen	1,76 %



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 87 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 39 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 48 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 97 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 87 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 39 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 48 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 10 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 3 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Gastgewerbe	Gastronomie	2,20 %
Energieversorgung	Stromverteilung	1,55 %
	Übertragung von Elektrizität	0,41 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	1,61 %
	Verwaltung der Finanzmärkte	4,14 %
	Lebensversicherung	2,91 %
	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	2,27 %
	Sonstige Kreditinstitute	0,43 %
	Sonstige Finanzdienstleistungen, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds a. n. g.	0,03 %
	Sonstige Kreditinstitute	3,88 %
	Immobilienaktivitäten	0,56 %
	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	2,72 %
Information und Kommunikation	IT-Beratungstätigkeiten	1,29 %
	Computerprogrammierungstätigkeiten	1,78 %
	Informationsdienste	0,03 %
	Sonstiges Verlagswesen	1,89 %
	Sonstige Softwareveröffentlichung	3,31 %
	Verlagsaktivitäten	1,72 %
	Fernsehsendungen und Rundfunk	1,33 %
	Webportale	4,15 %
	Drahtlose Telekommunikation	0,39 %
Herstellung	Herstellung von Land- und Forstmaschinen	1,34 %
	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	2,45 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	2,09 %
	Herstellung von elektronischen Komponenten	2,91 %
	Herstellung von Motoren und Turbinen, außer Motoren für Flugzeuge, Fahrzeuge und Fahrräder	1,49 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

	Herstellung von Mess-, Kontroll-, Navigations- und ähnlichen Instrumenten und Vorrichtungen	1,50 %
	Herstellung von Hebezeugen und Fördermitteln	1,69 %
	Herstellung von Koffern, Taschen und ähnliche Waren, und Sattlerwaren	1,83 %
	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	0,84 %
	Herstellung von medizinischen und zahnmedizinischen Apparaten und Materialien	1,13 %
	Herstellung von sonstigen chemischen Produkten a. n. g.	1,37 %
	Herstellung von sonstigen elektrischen Geräten	1,27 %
	Herstellung von sonstigen Sondermaschinen a. n. g.	2,21 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	7,09 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	3,83 %
	Herstellung von Seifen, Wasch-, Reinigungs- und Poliermitteln	1,89 %
	Andere Fertigung	2,67 %
Bergbau und Steinbruch	Gewinnung von Erdöl und Erdgas	1,76 %
Sonstige Dienstleistungen	Bestattung und damit verbundene Tätigkeiten	1,42 %
Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Ingenieurbüros	1,05 %
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	Allgemeine öffentliche Verwaltung	10,13 %
	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	4,78 %
Verkehr und Lagerei	Transport in Rohrfernleitungen	0,46 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	4,03 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 5 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

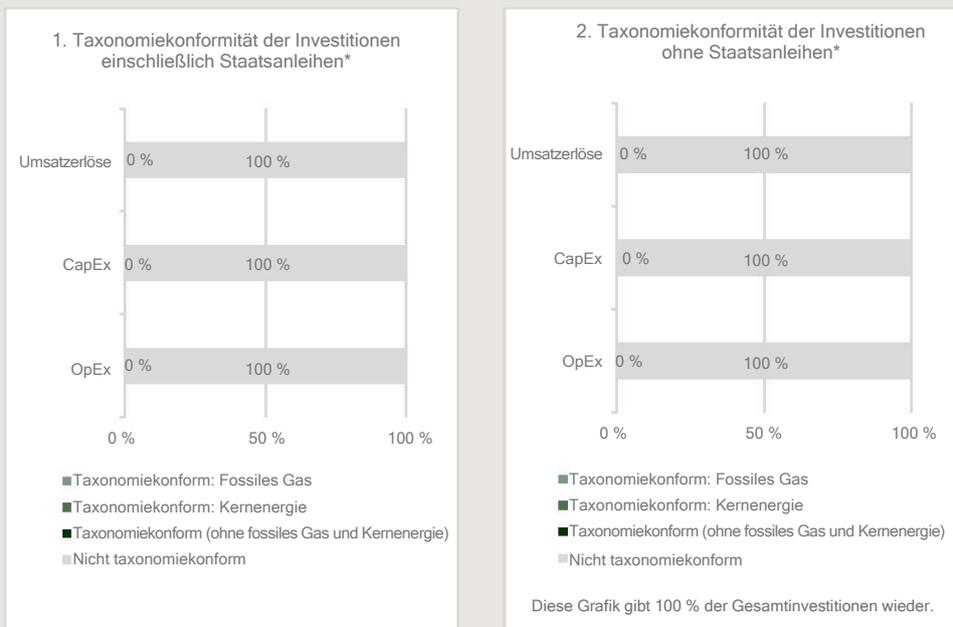
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**
Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 39 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 48 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart. Ebenfalls berücksichtigt wurden Investitionen, die aufgrund unzureichender Daten nicht als an den ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet bewertet werden können. Als Mindestschutz entsprechen diese Investitionen der JSS-Ausschlussrichtlinie und überschreiten nicht die definierten Umsatzschwellen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts verfolgte einen strikten Prozess, bei dem ESG-Aspekte integriert wurden. Der Anlageprozess des Anlageverwalters umfasste zwei wichtige ESG-Aspekte.

Das erste wichtige Element der Anlagestrategie, das zur Auswahl der Anlagen verwendet wurde, um die ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen, war die Analyse der bedeutenden nicht nachhaltigen Aktivitäten des Unternehmens, die anhand der proprietären Sarasin Sustainability Impact Matrix (SSIM) des Anlageverwalters identifiziert wurden.

Das zweite wichtige Element war die Strategie des Engagements und der Abstimmung, um das Unternehmen zum Übergang zu einem nachhaltigeren Ansatz zu bewegen. Die Zeiträume für einen Übergang variieren, aber in Fällen, in denen das Unternehmen, in das investiert wurde, als Unternehmen mit hohem Klimarisiko eingestuft wurde und es an einer ausdrücklichen Selbstverpflichtung und einem glaubwürdigen Übergangsplan fehlte, hat der Anlageverwalter direkt mit dem Unternehmen zusammengearbeitet, um es bei der Einführung einer Netto-Null-Strategie zu unterstützen. Unternehmen, die den Übergang nicht geschafft haben, stellen ein erhebliches finanzielles Risiko für die Anteilhaber dar, und ihre Beteiligungen an dem Produkt können schließlich vom Anlageverwalter verkauft werden.

Darüber hinaus wurde ein Bestandsscreening anhand der J. Safra Sustainability Matrix durchgeführt, um die Anwendung eines überdurchschnittlichen Branchen-ESG-Profiles sicherzustellen. Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert, wie in dieser Matrix definiert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Twelve Sustainable Insurance Bond

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493007PBLH88KG1CD22

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 76 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendants in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und –Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 97 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
die Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x			Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3). In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.
2	CO ₂ -Fußabdruck	x	x			
3	THG-Emissionsintensität	x	x			
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x			
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x			
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x			
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechts-spezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreter-stimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
FONDIARIA 5,75 % 14-PERP	IT	Nichtlebensversicherung	4,28 %
SANPAOLO VI 4,75 %/FRN 14-PERP	IT	Lebensversicherung	2,99 %
AXA 5,453 % (FRN) 14-PERP	FR	Lebensversicherung	2,83 %
CRDT AGR AS 4,75 % 16-27.09.48	FR	Risiko- und Schadensbewertung	2,75 %
LA MONDIALE 5,05 % 14-PERP	FR	Lebensversicherung	2,72 %
AXA 3,875 % 14-PERP	FR	Lebensversicherung	2,59 %
ASR 5,125 % 15-29.09.45	NL	Nichtlebensversicherung	2,52 %
ROTHESAY LI 8 % 15-30.10.25 REGS	GB	Nichtlebensversicherung	2,32 %
CATTOL ASS 4,25 % 17-14.12.47	IT	Lebensversicherung	2,27 %
PHOENIX GR 4,375 % 18-24.01.29	GB	Lebensversicherung	2,18 %
HISCOX LTD 6,125 % 15-24.11.45	BM	Nichtlebensversicherung	2,13 %
PENSION INS 8 % 16-23.11.26 REGS	GB	Rückversicherung	2,09 %
NN GROUP 4,5 % 14-PERP	NL	Lebensversicherung	2,07 %

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

NN GROUP 4,625 % 17-13.01.48	NL	Lebensversicherung	2,02 %
JUST GRP 7,0 % 20-15.04.31	GB	Lebensversicherung	1,77 %



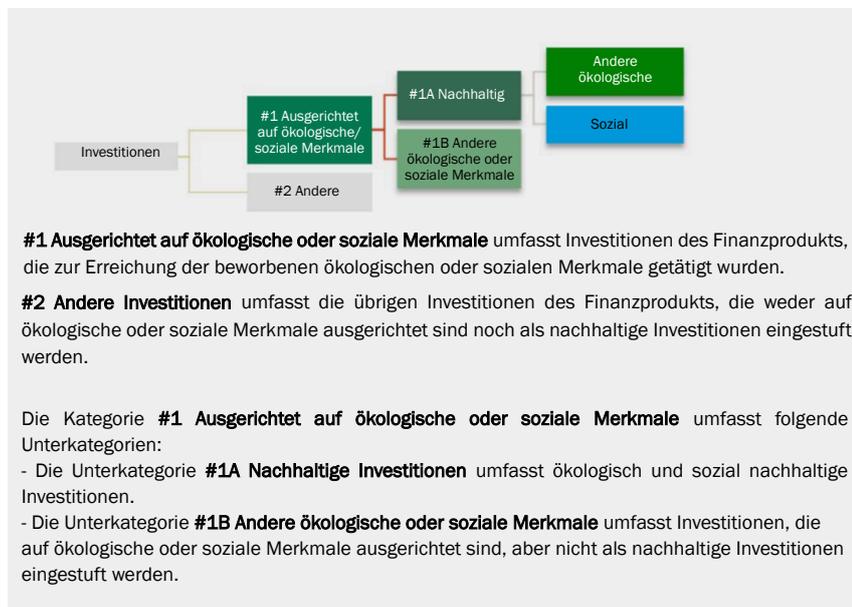
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 76 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 33 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 43 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 93 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 76 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 33 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 43 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 17 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 7 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Gastgewerbe	Gastgewerbe	1,04 %
	Beteiligungsgesellschaften	4,67 %
	Fondsmanagementaktivitäten	2,53 %
	Lebensversicherung	47,95 %
	Nichtlebensversicherung	26,12 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Sonstige Kreditinstitute	0,01 %
	Rückversicherung	8,33 %
	Risiko- und Schadensbewertung	3,88 %
	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	1,70 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 2 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

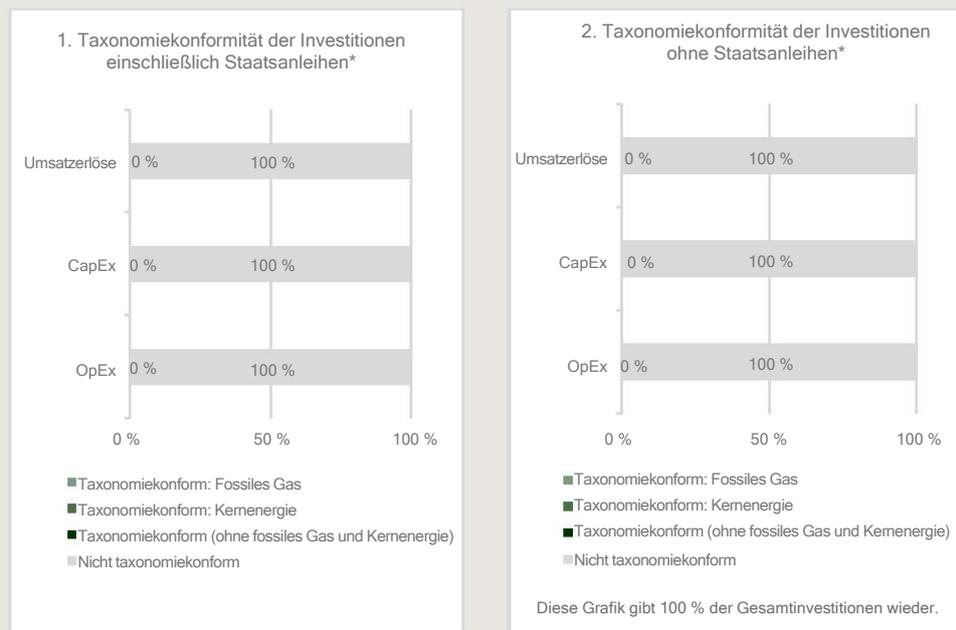
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**
Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 33 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 43 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart. Ebenfalls berücksichtigt wurden Investitionen, die aufgrund unzureichender Daten nicht als an den ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet bewertet werden können. Als Mindestschutz entsprechen diese Investitionen der JSS-Ausschlussrichtlinie und überschreiten nicht die definierten Umsatzschwellen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts verfolgte einen strengen Prozess, bei dem ESG-Aspekte durchweg integriert wurden. Der Anlageverwalter berücksichtigte die folgenden Kriterien in seiner Strategie:

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

(a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie. Darüber hinaus schließt das Finanzprodukt Emittenten mit unkonventionellen Öl- und Gasaktivitäten (Teersand und Fracking) aus, wenn die mit diesen Aktivitäten erwirtschafteten Erträge mehr als 5 % betragen.

(b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen. Emittenten mit einem Rating von A- oder B werden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt ist. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickeln und nicht unter die definierten Schwellenwerte fallen;

(c) Um ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erzielen, investierte dieses Produkt nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating;

(d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der nachhaltigen Entwicklungsziele (SDGs) der UN übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Equity - Global Thematic

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300VK5TIMLG877860

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 87 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 91 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating und 9 % der Anlagen des Produkts ein B-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**
Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 4,18 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 4,18 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x			Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3). In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.
2	CO ₂ -Fußabdruck	x	x			
3	THG-Emissionsintensität	x	x			
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x			
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x			
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x			
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
ACTIVISION BLIZZARD INC	USA	Veröffentlichung von Computerspielen	4,85 %
AMAZON COM INC	USA	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	4,52 %
ALPHABET INC -A-	USA	Webportale	4,02 %
MICROSOFT CORP.	USA	Sonstige Softwareveröffentlichung	3,83 %
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GB	Herstellung von Papier und Papierprodukten	3,61 %
AIA GROUP LTD	HK	Lebensversicherung	3,49 %
META PLATFORMS REGISTERD SHS A	USA	Informationsdienste	3,42 %
WALT DISNEY	USA	Fernsehsendungen und Rundfunk	3,29 %
LSE GROUP	GB	Verwaltung der Finanzmärkte	3,19 %
SMITH AND NEPHEW PLC	GB	Andere Fertigung	2,91 %
TELEFLEX INC	USA	Andere Fertigung	2,90 %
MEDTRONIC HOLDINGS LIMITED	IE	Andere Fertigung	2,79 %
SPLUNK INC	USA	Sonstige Softwareveröffentlichung	2,71 %
SHISEIDO CO.LTD	JP	Herstellung von Papier und Papierprodukten	2,44 %
SERVICENOW INC	USA	Computerprogrammierungstätigkeiten	2,39 %



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 87 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 40 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 47 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 97 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 87 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 40 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 47 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 10 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 3 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Gastgewerbe	Gastronomie	1,94 %
Sonstige wirtschaftliche Dienstleistungen	Andere Reservierungsdienste und zugehörige Aktivitäten	1,76 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Verwaltung der Finanzmärkte	5,49 %
	Lebensversicherung	5,11 %
	Sonstige Kreditinstitute	0,29 %
Information und Kommunikation	Computerprogrammierungstätigkeiten	2,02 %
	Informationsdienste	4,06 %
	Sonstige Softwareveröffentlichung	6,00 %
	Veröffentlichung von Computerspielen	3,13 %
	Fernsehsendungen und Rundfunk	2,60 %
	Webportale	4,29 %
Herstellung	Herstellung von Erfrischungsgetränken; Gewinnung natürlicher Mineralwasser und Herstellung von sonstigem abgefülltem Wasser	2,03 %
	Herstellung von Land- und Forstmaschinen	1,41 %
	Herstellung von pharmazeutischen Grundstoffen und pharmazeutischen Präparaten	1,76 %
	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	1,60 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	4,71 %
	Herstellung von elektronischen Komponenten	2,16 %
	Herstellung von Motoren und Turbinen, außer Motoren für Flugzeuge, Fahrzeuge und Fahrräder	1,68 %
	Herstellung von Mess-, Kontroll-, Navigations- und ähnlichen Instrumenten und Vorrichtungen	1,69 %
	Herstellung von Hebezeugen und Fördermitteln	1,52 %
	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	1,09 %
	Herstellung von medizinischen und zahnmedizinischen Apparaten und Materialien	1,28 %
	Herstellung von sonstigen chemischen Produkten a. n. g.	1,20 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

	Herstellung von sonstigen elektrischen Geräten	1,58 %
	Herstellung von sonstiger Oberbekleidung	1,65 %
	Herstellung von sonstigen Sondermaschinen a. n. g.	2,03 %
	Herstellung von sonstiger Transportausrüstung	1,49 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	7,45 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	2,12 %
	Herstellung von Seifen, Wasch-, Reinigungs- und Poliermitteln	3,47 %
	Andere Fertigung	8,08 %
Bergbau und Steinbruch	Gewinnung von Erdöl und Erdgas	1,89 %
Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Ingenieurbüros	2,06 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	6,69 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 8 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

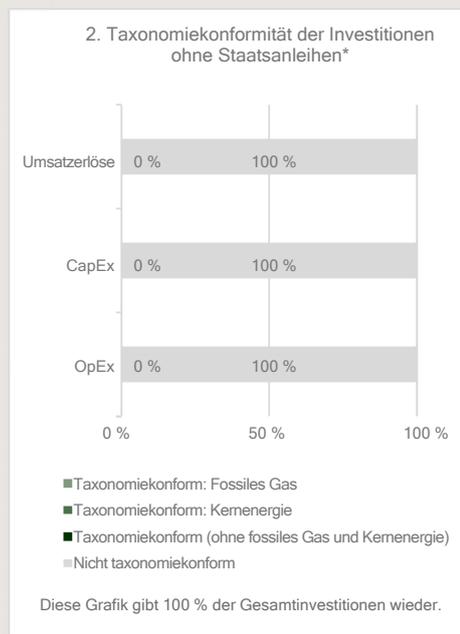
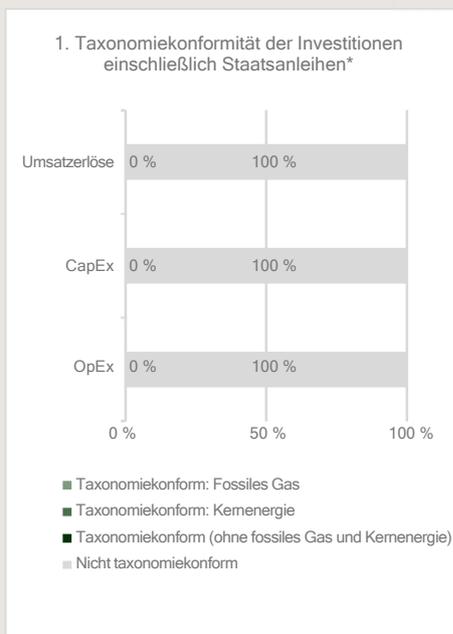
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 40 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 47 %.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts verfolgte einen strengen Prozess, bei dem ESG-Aspekte durchweg integriert wurden. Der Anlageverwalter berücksichtigte die folgenden Kriterien in seiner Strategie:

(a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie. Darüber hinaus schließt das Finanzprodukt Emittenten mit unkonventionellen Öl- und Gasaktivitäten (Teersand und Fracking) aus, wenn die mit diesen Aktivitäten erwirtschafteten Erträge mehr als 5 % betragen.

(b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen. Emittenten mit einem Rating von A- oder B werden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt ist. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickeln und nicht unter die definierten Schwellenwerte fallen;

(c) Um ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erzielen, investierte dieses Produkt nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating;

(d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der nachhaltigen Entwicklungsziele (SDGs) der UN übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Bond - Global Short-term

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300RNF CXJVV1C4M46

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 70 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 44 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating und 46 % der Anlagen des Produkts ein B-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**
Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 4,65 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 4,65 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x			Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3). In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.
2	CO ₂ -Fußabdruck	x	x			
3	THG-Emissionsintensität	x	x			
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x			
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x			
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x			
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechts-spezifisches Verdienstgefälle					Derzeit für dieses Produkt nicht bewertet. JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen				Derzeit für dieses Produkt nicht bewertet. JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x			JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen					
15	THG-Emissionsintensität		x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen		x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
BANCOLOMBIA 3,0 % 20-29.01.25	CO	Sonstige Kreditinstitute	1,26 %
INVERSIONES 4,75 % 14-15.09.24	CL	Herstellung von Papier und Papierprodukten	1,21 %
BK CN MACAU FRN 22-28.04.25	MO	Sonstige Kreditinstitute	1,15 %
REC LTD 5,25 % 18-13.11.23 REGS	IN	Finanzierungsleasing	1,15 %
ST BK INDIA 4,375 % 24.1.24 REGS	GB	Sonstige Kreditinstitute	1,14 %
WOORI BK 4,75 % 14-30.04.24	KR	Sonstige Kreditinstitute	1,14 %
FIBRIA 4 % 17-14.01.25	KY	Herstellung von Papier und Papierprodukten	1,14 %
SANTANDER 5,375 % 20-17.4.25 REGS	MX	Sonstige Kreditinstitute	1,14 %
TRUST F 5,25 % 14-15.12.24 REGS	MX	Immobilienaktivitäten	1,12 %
GS-CALTEX 4,50 % 22-05.01.26	KR	Energieversorgung	1,12 %
BOC AVIATIO 3,25 % 20-29.04.25 REGS	SG	Finanzierungsleasing	1,10 %
KOREAREHABN 4,125 % 22- 20.04.27	KR	Vermittlung von Wertpapieren und Warentermingeschäften	1,09 %
AFRICA FINA 3,125 % 20-16.06.25	NG	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,07 %

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

CENCOSUD 5,15 % 15-12.02.25	CL	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorädern	1,06 %
ARAUCO 4,5 % 14-01.08.24	CL	Herstellung von Papier und Papierprodukten	1,04 %



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 70 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 33 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 37 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

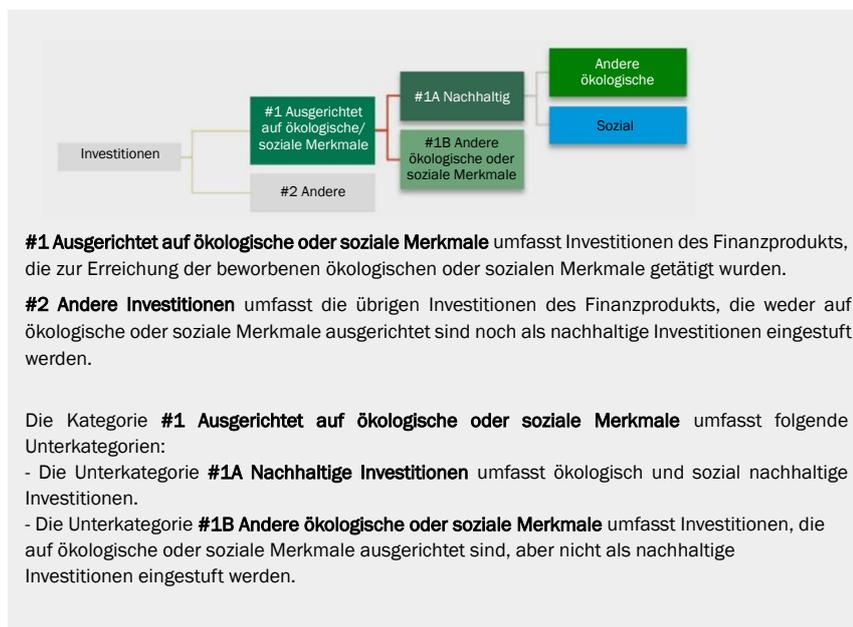
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 91 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 70 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 33 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 37 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 21 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 9 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	Wassergewinnung, -aufbereitung und -versorgung	0,37 %
Baugewerbe	Bau von Versorgungsprojekten für Strom und Telekommunikation	0,92 %
Energieversorgung	Energieversorgung	2,92 %
	Stromerzeugung	0,73 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	4,05 %
	Central Banking	6,36 %
	Finanzierungsleasing	5,81 %
	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	0,96 %
	Sonstige Kreditinstitute	30,55 %
	Immobilienaktivitäten	2,51 %
	Vermietung und Betrieb von eigenen oder geleasteten Immobilien	0,38 %
	Vermittlung von Wertpapieren und Warentermingeschäften	1,09 %
	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	0,71 %
Information und Kommunikation	Informationsdienste	0,76 %
	Sonstiges Verlagswesen	2,66 %
	Programm- und Sendetätigkeit	2,52 %
	Telekommunikation	2,32 %
	Drahtlose Telekommunikation	0,87 %
Herstellung	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	1,77 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	0,79 %
	Herstellung von Lebensmittelprodukten	1,80 %
	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	0,38 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	3,95 %
	Herstellung	2,71 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Bergbau und Steinbruch	Gewinnung von Erdöl und Erdgas	1,66 %
	Abbau von Metallerzen	0,67 %
Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	Allgemeine öffentliche Verwaltung	1,09 %
	Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	13,03 %
Verkehr und Lagerei	Dienstleistungen für den Wasserverkehr	0,18 %
	Verkehr und Lagerei	1,92 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	0,74 %
	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	2,99 %
	Großhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	0,44 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 7 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

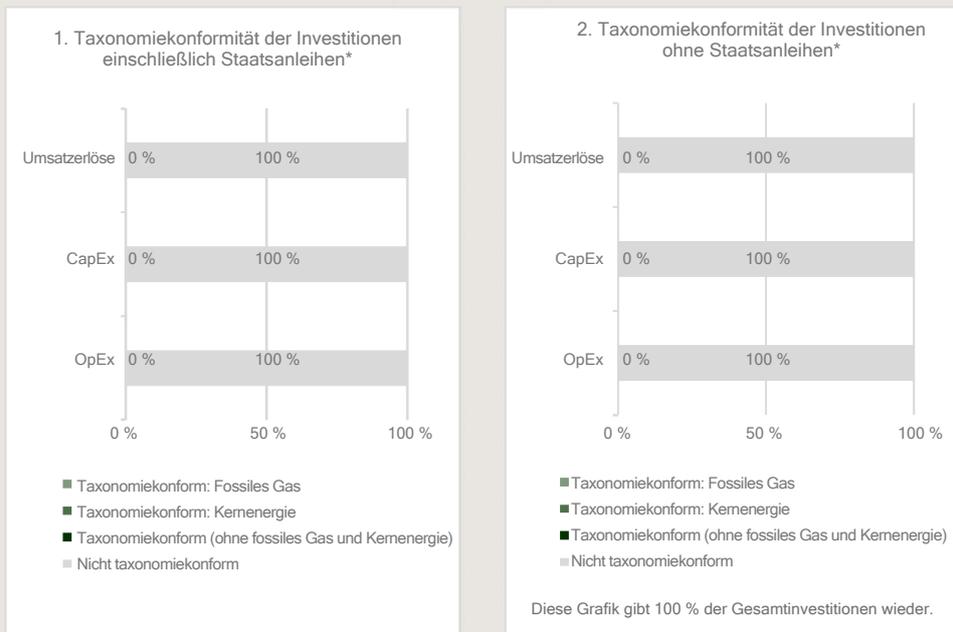
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 33 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 37 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart. Ebenfalls berücksichtigt wurden Investitionen, die aufgrund unzureichender Daten nicht als an den ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet bewertet werden können. Als Mindestschutz entsprechen diese Investitionen der JSS-Ausschlussrichtlinie und überschreiten nicht die definierten Umsatzschwellen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

- (a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie;
- (b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;
- (c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert;
- (d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Während des Berichtszeitraums befanden sich die Unternehmen des Produkts, in die investiert wird, nicht im Bereich der Mitwirkungsaktivitäten des Anlageverwalters.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Bond CHF

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300EPS53HD8OG4G84

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 83 % an nachhaltigen Investitionen.

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO2-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 91 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating und 9 % der Anlagen des Produkts ein B-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x		x	Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der
2	CO2-Fußabdruck	x	x		x	
3	THG-Emissionsintensität	x	x		x	
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x		x	
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x		x	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x		x	<p>Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3).</p> <p>In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.</p> <p>Im Mai 2020 startete JSS ein Klimaversprechen mit dem Ziel, bis 2035 einen CO2-neutralen Ausgang zu erreichen. Kontrollen der THG-Emissionen werden anhand des CO2-Fußabdrucks durchgeführt und gelten für eine Untergruppe von Fonds. Das Klimaversprechen wird für die nachhaltigen Anlagestrategien umgesetzt und durch den rückwärts gerichteten Dekarbonisierungspfad verfolgt, um Übergangsrisiken zu mindern. Die Methodik definiert die Zielsetzung als eine Reduzierung des THG-Emissionen-Fußabdrucks der Benchmark um 30 %, der in den folgenden Jahren um 7 % reduziert wird. Ab 2030 reduziert sich das Ziel linear bis zum Erreichen von Netto-Null in 2035.</p> <p>Die THG-Emissionen des Portfolios auf Basis der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO2e pro USD Mio. EVIC ausgedrückt.</p>
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			<p>In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.</p>

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
ICO 3,25 % 07-28.6.24 EMTN	ES	Sonstige Kreditinstitute	2,51 %
UNIBAIL ROD 2 % 13-20.11.23	FR	Vermietung und Betrieb von eigenen oder geleasten Immobilien	2,45 %
AT&T INC 1,375 % 14-04.12.24	USA	Drahtlose Telekommunikation	2,44 %
WPLAU 1 % 16-11.12.23	AU	Gewinnung von Erdöl	2,44 %
NBADUH 0,3225 % 18-27.09.23	AE	Sonstige Kreditinstitute	2,44 %
AUCHAN 1,5 % 14-03.06.24	FR	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	2,42 %
BEI 3,125 % 06-30.06.36	LU	Sonstige Kreditinstitute	2,29 %
KFW 2,5 % 05-25.08.25	DE	Sonstige Kreditinstitute	2,28 %
CELLNEX TEL 0,775 % 20-18.02.27	ES	Drahtlose Telekommunikation	2,25 %
MUNHYP 0,35 % 18-12.12.23	DE	Sonstige Kreditinstitute	1,94 %
CBQ FINANCE 0,735 % 20-27.11.24	BM	Sonstige Kreditinstitute	1,91 %
MUNHYP 0,25 % 19-10.05.30	DE	Sonstige Kreditinstitute	1,74 %
ELI LILLY 0,15 % 16-24.05.24	USA	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	1,69 %
TRANSURBAN 0,875 % 21-19.11.31	AU	Beteiligungsgesellschaften	1,69 %
KOMMKRDT 2,875 % 06-13.10.31	DK	Sonstige Finanzdienstleistungen, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds a. n. g.	1,60 %



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

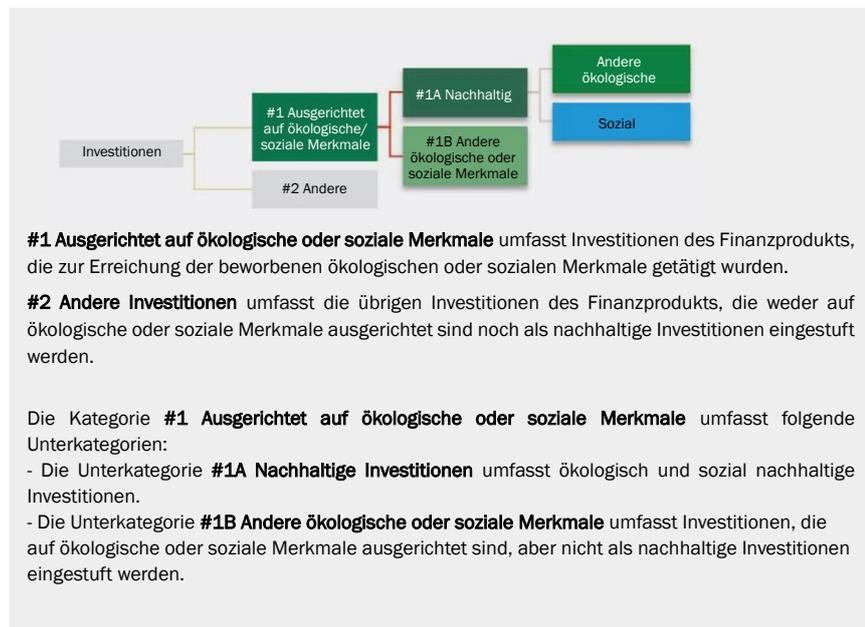
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 83 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 41 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 42 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 99 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 83 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 41 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 42 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 16 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 1 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Energieversorgung	Stromerzeugung	0,98 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	3,77 %
	Central Banking	2,31 %
	Sonstige Kreditinstitute	4,34 %
	Sonstige Finanzdienstleistungen, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds a. n. g.	2,59 %
	Sonstige Kreditinstitute	49,22 %
	Vermietung und Betrieb von eigenen oder geleasteten Immobilien	2,44 %
	Vermittlung von Wertpapieren und Warentermingeschäften	5,09 %
	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	4,40 %
	Information und Kommunikation	Drahtlose Telekommunikation
Herstellung	Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	0,95 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	2,08 %
Bergbau und Steinbruch	Gewinnung von Erdöl	2,41 %
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	5,17 %
	Regulierung der Tätigkeiten in den Bereichen Gesundheitsversorgung, Bildung, kulturelle Dienstleistungen und andere soziale Dienstleistungen, ausgenommen soziale Sicherheit	3,29 %
Verkehr und Lagerei	Dienstleistungen für den Luftverkehr	0,95 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	2,38 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 3 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

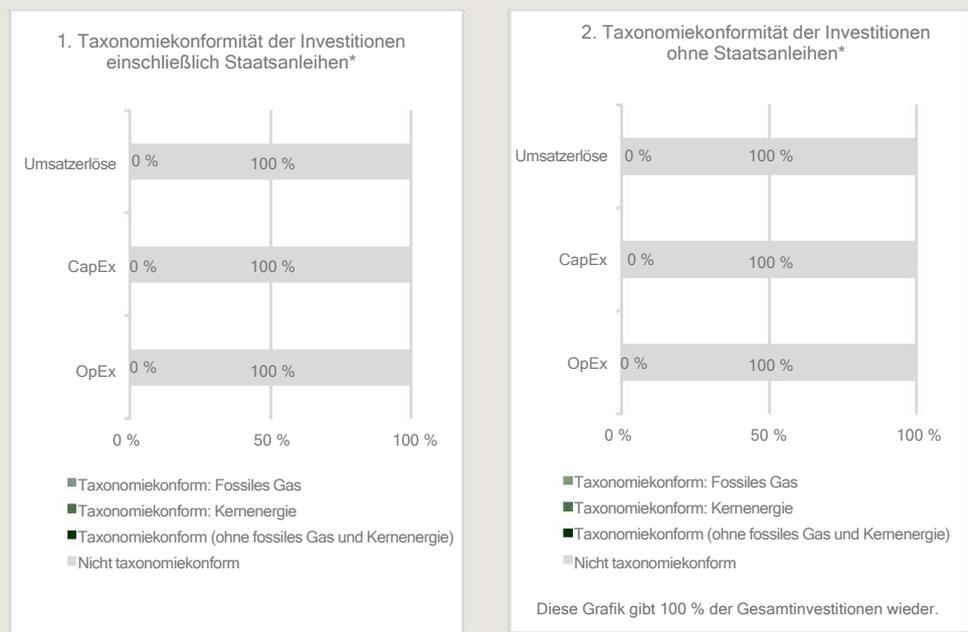
Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**
Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 41 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 42 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

- (a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie;
- (b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;
- (c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert;
- (d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Bond - Euro Broad

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493000W9WO226KD5J14

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 42 %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 51 %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das Ziel des Produkts ist es, einen Beitrag zum Klimaschutz zu leisten, um im Laufe der Zeit den CO₂-Fußabdruck (behauptete CO₂-Emissionen pro investierter Millionen USD) zu reduzieren, bis es bis 2035 im Einklang mit dem Klimaversprechen von J. Safra Sarasin („JSS“) das Netto-Null-Ziel erreicht hat. Die Methodik für den Zielsetzungsprozess leitet sich aus der Verordnung über EU-Referenzwerte für den klimabedingten Wandel ab, bei der das Ziel besteht, den CO₂-Fußabdruck (behauptete CO₂-Emissionen pro investierter Million USD) -30 % unter dem CO₂-Fußabdruck des vergleichbaren Marktes zu halten. Darüber hinaus strebt das Produkt für Unternehmensemittenten einen anfänglichen CO₂-Fußabdruck an, der 2020 mindestens 30 % unter dem CO₂-Fußabdruck der aktuellen Benchmark liegt. Jedes Jahr sollte die Schwelle im Durchschnitt bis 2030 um mindestens 7 % gesenkt werden, im Einklang mit dem Dekarbonisierungskurs des Intergovernmental Panel on Climate Change (IPCC) mit dem 1,5 °C-Szenario oder darüber hinausgehend (ohne oder mit begrenztem Überschreiten). Von 2030 bis 2035 soll der CO₂-Fußabdruck des Produkts auf (Netto-)Null sinken.

Um sein Ziel zu erreichen, investierte das Produkt in grüne Anleihen und in soziale und/oder nachhaltige Anleihen, wie sie in Marktstandards, wie Green Bond, Social Bond, Sustainability Bond und Sustainability-Linked Principles sowie in offiziellen Verordnungen wie die EU-Verordnung über grüne Anleihen definiert sind. Diese Anleihen werden zur Finanzierung oder

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Refinanzierung bestimmter grüner Projekte begeben, die positive ökologische, soziale und/oder klimatische Vorteile aufweisen. Das Finanzprodukt zielte darauf ab, zu einer Reihe von Umweltzielen beizutragen, wie Klimaschutz, Anpassung an den Klimawandel, nachhaltige Nutzung und Schutz von Wasser- und Meeresressourcen, Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft, Vermeidung und Verminderung der Umweltverschmutzung und Schutz und Wiederherstellung der Biodiversität und der Ökosysteme sowie zum sozialen Ziel der Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Darüber hinaus strebte das Produkt ein überdurchschnittliches Umwelt-, Sozial- oder Governance-Profil („ESG“) für das gesamte Portfolio auf der Grundlage der JSS Sustainability Matrix an. Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Dieses Finanzprodukt fällt in den Geltungsbereich des JSS Climate Pledge, das darauf abzielt, den CO₂-Fußabdruck der Anlageportfolios von JSS zu reduzieren. Zum 30.06.2023 entsprach der CO₂-Fußabdruck des Portfolios dem durch die Verpflichtung auferlegten Übergangspfad, mit einer Intensität der Kohlenstoffemissionen von 16,92 Tonnen CO₂ pro investierter Million USD im Vergleich zur Finanzbenchmark mit 52,47 Tonnen CO₂ pro investierter Million USD.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Alle Zahlen werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

- Anteil der mit A- und B-Ratings bewerteten Vermögenswerte und durchschnittliches Rating der Portfoliounternehmen: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten und resultiert in einem Punktwert von 0 (niedrig) bis 5 (hoch). Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums waren 99 % der Anlagen des Produkts mit A- bewertet und das durchschnittliche Unternehmensrating lag bei 3,6. Das durchschnittliche Unternehmensrating für die Finanzbenchmark lag bei 3,5.

- CO₂-Fußabdruck gemessen anhand der Angaben zu CO₂-Emissionen pro investierter Million USD. Im Berichtszeitraum betrug der CO₂-Fußabdruck **16,92** Tonnen CO₂ pro investierter Million USD. Im gleichen Zeitraum verzeichnete die finanzielle Benchmark einen CO₂-Fußabdruck von **52,47** Tonnen CO₂ pro investierter Million USD.

- Anteil grüner Anleihen: 34,43 %

- Anteil sozialer und/oder nachhaltiger Anleihen: 19,75 %

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend

● **Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 0,98 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
 die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
 die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
 die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
 die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
 das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
 das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 0,98 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x		x	Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.
2	CO2-Fußabdruck	x	x		x	
3	THG-Emissionsintensität	x	x		x	
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x		x	In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x		x	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x		x	<p>eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3).</p> <p>In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.</p> <p>Im Mai 2020 startete JSS ein Klimaversprechen mit dem Ziel, bis 2035 einen CO₂-neutralen Ausgang zu erreichen. Kontrollen der THG-Emissionen werden anhand des CO₂-Fußabdrucks durchgeführt und gelten für eine Untergruppe von Fonds. Das Klimaversprechen wird für die nachhaltigen Anlagestrategien umgesetzt und durch den rückwärts gerichteten Dekarbonisierungspfad verfolgt, um Übergangsrisiken zu mindern. Die Methodik definiert die Zielsetzung als eine Reduzierung des THG-Emissionen-Fußabdrucks der Benchmark um 30 %, der in den folgenden Jahren um 7 % reduziert wird. Ab 2030 reduziert sich das Ziel linear bis zum Erreichen von Netto-Null in 2035.</p> <p>Die THG-Emissionen des Portfolios auf Basis der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro USD Mio. EVIC ausgedrückt.</p>
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			<p>In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.</p>

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
NETHER GOVE 0,5 % 19-15.1.40	NL	Allgemeine öffentliche Verwaltung	4,88 %
KFW 1,375 % 22-07.06.32	DE	Sonstige Kreditinstitute	4,45 %
NTH RHINE-W 0 % 19-26.11.29	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	3,50 %
EU 0,0 % 21-02.06.28	BE	Aktivitäten exterritorialer Organisationen und Körperschaften	2,91 %
NETHER GOVE 0,50 % 22-15.07.32	NL	Allgemeine öffentliche Verwaltung	2,62 %
CPPIB CAPIT 0,875 % 19-06.02.29	CA	Fondsmanagementaktivitäten	2,26 %
NRW BK 0,0 % 20-18.02.30	DE	Sonstige Kreditinstitute	2,06 %
CASSA DEPO 1,0 % 20-11.02.30	IT	Sonstige Finanzdienstleistungen, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds a. n. g.	2,04 %
CASSA DEPO 1,0 % 20-21.09.28	IT	Sonstige Finanzdienstleistungen, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds a. n. g.	2,01 %
ITALY 0,50 % 20-01.02.26 /BTP	IT	Allgemeine öffentliche Verwaltung	1,93 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

AUCKLAND CO 0,25 % 21-17.11.31	NZ	Allgemeine öffentliche Verwaltung	1,82 %
ITALY 4,0 % 22-30.04.35 /BTP	IT	Allgemeine öffentliche Verwaltung	1,73 %
NTH RHINE-W 0,0 % 20-12.10.35	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	1,72 %
COM.DI MILANO 4,019 % 05-29.6.35	IT	Allgemeine öffentliche Verwaltung	1,58 %
FRANCE O.A. 0 % 16-25.05.52	FR	Allgemeine öffentliche Verwaltung	1,52 %



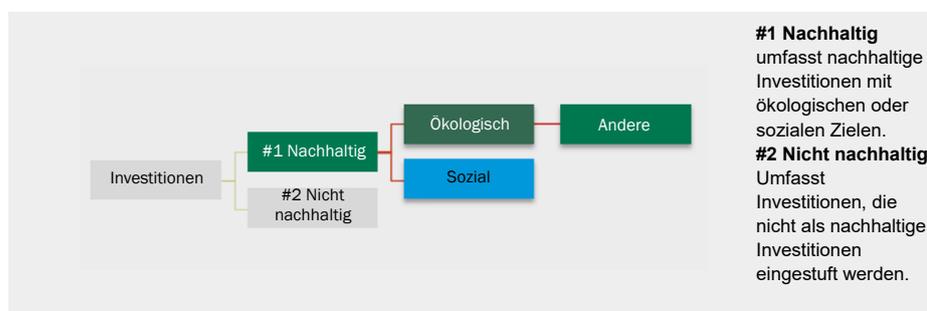
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 93 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 42 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 51 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Kategorie „#1 Nachhaltig“ bestand zu 93 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Ökologische Merkmale“ betrug 42 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 51 %. Der Anteil der unter „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ enthaltenen Anlagen betrug 7 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Aktivitäten extraterritorialer Organisationen und Körperschaften	Aktivitäten extraterritorialer Organisationen und Körperschaften	3,63 %
Sonstige wirtschaftliche Dienstleistungen	Sonstige geschäftliche Unterstützungsdienstleistungen a. n. g.	0,29 %
Baugewerbe	Bau von Eisenbahnen und U-Bahnen	2,05 %
	Bau von Straßen und Autobahnen	0,17 %
Energieversorgung	Stromverteilung	0,65 %
	Verteilung gasförmiger Brennstoffe durch Rohrleitungen	0,15 %
	Energieversorgung	0,68 %
	Stromerzeugung	0,08 %
	Handel mit Elektrizität	0,62 %
	Handel mit Gas über das Leitungsnetz	0,19 %
	Übertragung von Elektrizität	0,17 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	0,72 %
	Fondsmanagementaktivitäten	2,41 %
	Lebensversicherung	2,04 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

	Nichtlebensversicherung	1,32 %
	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	0,27 %
	Sonstige Kreditinstitute	4,43 %
	Sonstige Finanzdienstleistungen, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds a. n. g.	7,41 %
	Sonstige Kreditinstitute	24,76 %
	Rückversicherung	0,19 %
	Vermittlung von Wertpapieren und Warentermingeschäften	0,35 %
	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	3,81 %
Information und Kommunikation	IT-Beratungstätigkeiten	0,36 %
	Verlagsaktivitäten	0,17 %
	Satellitenkommunikation	0,38 %
	Telekommunikation	0,15 %
	Kabelgebundene Telekommunikation	0,20 %
	Drahtlose Telekommunikation	0,14 %
Herstellung	Herstellung, Runderneuerung und Reparatur von Bereifungen	0,09 %
	Herstellung von Erfrischungsgetränken; Gewinnung natürlicher Mineralwasser und Herstellung von sonstigem abgefülltem Wasser	0,12 %
	Herstellung von Spirituosen	0,23 %
	Herstellung von Lagern, Getrieben, Zahnrädern und Antriebselementen	0,20 %
	Herstellung von Getränken	0,09 %
	Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	0,30 %
	Herstellung von Lebensmittelprodukten	0,07 %
	Herstellung von Schuhen	0,08 %
	Herstellung von Getreidemühlenprodukten	0,28 %
	Herstellung von Bestrahlungsgeräten, elektromedizinischen und elektrotherapeutischen Geräten	0,60 %
	Herstellung von Schmuck, Gold- und Silberschmiedewaren (ohne Fantasieschmuck)	0,09 %
	Herstellung von sonstiger Oberbekleidung	0,15 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	0,08 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	0,37 %
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	Allgemeine öffentliche Verwaltung	35,61 %
	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,05 %
	Regulierung und Beitrag zu einem effizienteren Betrieb von Unternehmen	0,15 %
Verkehr und Lagerei	Dienstleistungen für den Landverkehr	0,12 %
	Verkehr und Lagerei	0,62 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	0,09 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 2 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

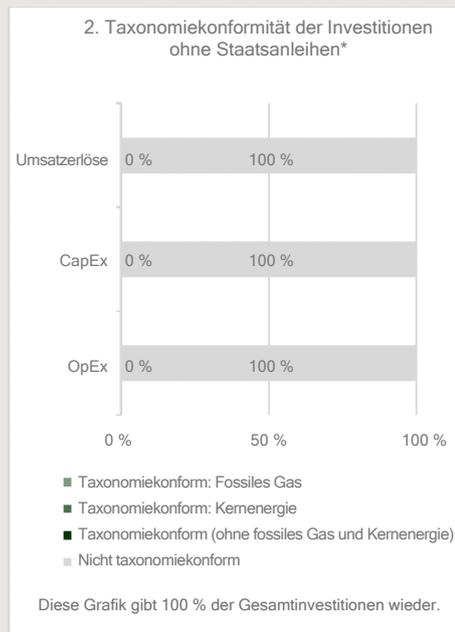
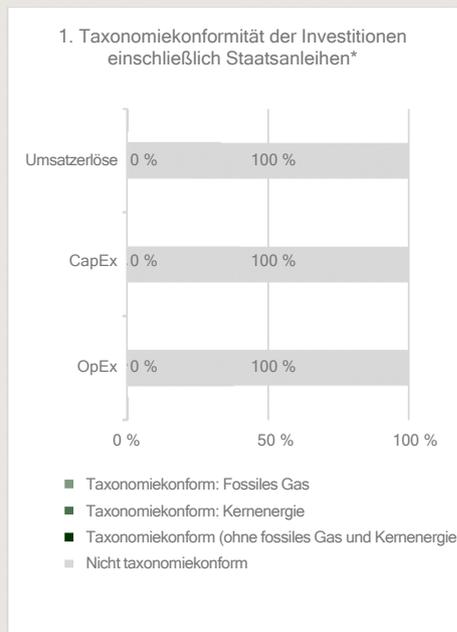
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 42 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 51 %.



Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Ebenfalls enthalten sind die übrigen Investitionen des Produkts. Diese Investitionen wurden gemäß der JSS Sustainability Matrix mit A bewertet, erfüllen jedoch nicht die Kriterien für die Einstufung als nachhaltige Investitionen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

(a) Ausschluss von Investitionen in umstrittene Geschäftsaktivitäten gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie. Zusätzlich wurden die folgenden Ausschlüsse angewendet: Teersand, Fracking und herkömmliche Kohle, Öl und Gas, wenn die mit diesen Aktivitäten erwirtschafteten Erträge mehr als 5 % betragen;

(b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen. Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickeln und nicht unter die definierten Schwellenwerte fallen;

(c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte ausschließlich in Emittenten mit A-Rating. Mindestens 30 % des Nettovermögens des Produkts müssen in grüne Anleihen und entweder in als sozial oder nachhaltig gekennzeichnete Anleihen investiert worden sein;

(d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der nachhaltigen Entwicklungsziele (SDGs) der UN übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter bei ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um eine Verhaltensänderung hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung des nachhaltigen Investitionsziels zu bewirken.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Bei den **Referenzwert** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300ODE4AHUU0FOY34

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 82 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendants in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 98 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**
Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**
Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 4,47 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 4,47 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x		x	Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen
2	CO2-Fußabdruck	x	x		x	
3	THG-Emissionsintensität	x	x		x	
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x		x	
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x		x	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x		x	<p>Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3). In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.</p> <p>Im Mai 2020 startete JSS ein Klimaversprechen mit dem Ziel, bis 2035 einen CO2-neutralen Ausgang zu erreichen. Kontrollen der THG-Emissionen werden anhand des CO2-Fußabdrucks durchgeführt und gelten für eine Untergruppe von Fonds. Das Klimaversprechen wird für die nachhaltigen Anlagestrategien umgesetzt und durch den rückwärts gerichteten Dekarbonisierungspfad verfolgt, um Übergangsrisiken zu mindern. Die Methodik definiert die Zielsetzung als eine Reduzierung des THG-Emissionen-Fußabdrucks der Benchmark um 30 %, der in den folgenden Jahren um 7 % reduziert wird. Ab 2030 reduziert sich das Ziel linear bis zum Erreichen von Netto-Null in 2035. Die THG-Emissionen des Portfolios auf Basis der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO2e pro USD Mio. EVIC ausgedrückt.</p>
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			<p>In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.</p>

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechts-spezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
DEUTSCH 1,375 % 18-28.03.31 REGS	NL	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	2,02 %
JNJ 1,15 % 16-20.11.28	USA	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	1,85 %
FONDIARIA 5,75 % 14-PERP	IT	Nichtlebensversicherung	1,74 %
E.ON 1,625 % 22-29.03.31	DE	Handel mit Elektrizität	1,50 %
VR-GROUP PL 2,375 % 22-30.05.29	PL	Verkehr und Lagerei	1,49 %
GN ST NORD 0,875 % 21-25.11.24	DK	Herstellung von Bestrahlungsgeräten, elektromedizinischen und elektrotherapeutischen Geräten	1,48 %
MACQUARIE G 0,95 % 21-21.05.31	AU	Sonstige Kreditinstitute	1,33 %
SWISS LIFE 4,375 % 15-PERP	NL	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	1,32 %
MEDTRNC 1,375 % 20-15.10.40	LU	Sonstige Finanzdienstleistungen, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds a. n. g.	1,18 %
SEB 1,375 % (FRN) 16-31.10.28	SE	Sonstige Kreditinstitute	1,15 %
KBC 1,50 % (FRN) 22-29.03.26	BE	Sonstige Kreditinstitute	1,12 %
BFCM 2,625 % 22-06.11.29	FR	Sonstige Kreditinstitute	1,06 %
ABBOTT IL F 0,375 % 19-19.11.27	IE	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	1,03 %
GLBWR RE ES 3 % 18-29.03.25 REGS	GG	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	1,02 %
MADRILENA R 2,25 % 17-11.04.29	NL	Energieversorgung	1,00 %

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

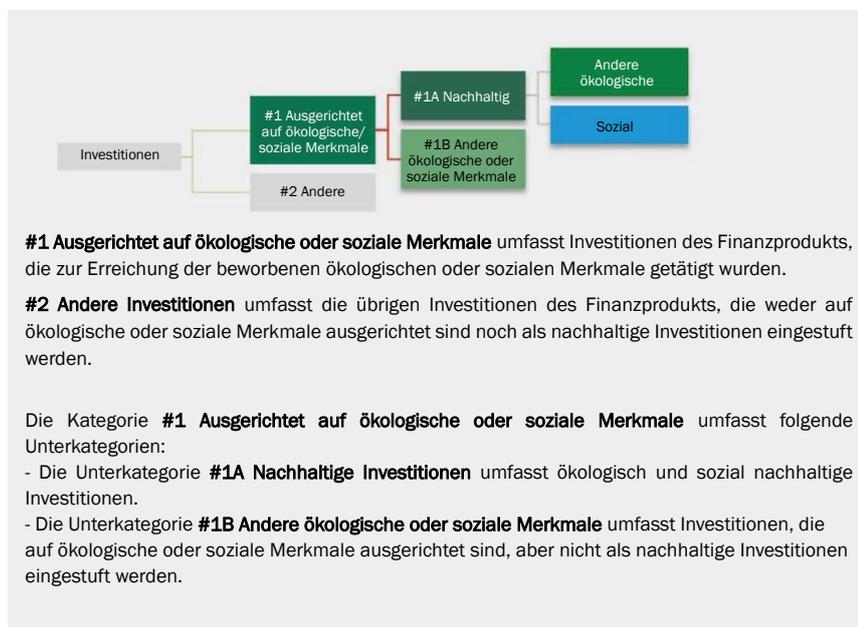
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 82 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 40 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 42 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 96 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 82 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 40 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 42 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 14 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 4 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Gastgewerbe	Gastronomie	0,21 %
	Beherbergungsbetriebe	0,56 %
Sonstige wirtschaftliche Dienstleistungen	Büroverwaltung, Bürounterstützung und sonstige geschäftliche Unterstützungsdienstleistungen	0,50 %
	Sonstige geschäftliche Unterstützungsdienstleistungen a. n. g.	0,45 %
	Gebäudedienstleistungen und Landschaftspflege	0,48 %
Baugewerbe	Tiefbau	0,82 %
	Bau von Straßen und Autobahnen	0,55 %
Energieversorgung	Stromverteilung	0,40 %
	Energieversorgung	3,32 %
	Handel mit Elektrizität	1,84 %
	Handel mit Gas über das Leitungsnetz	0,29 %
	Übertragung von Elektrizität	0,23 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	2,04 %
	Finanzierungsleasing	1,04 %
	Lebensversicherung	4,14 %
	Nichtlebensversicherung	2,29 %
	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	2,26 %
	Sonstige Kreditinstitute	0,77 %
	Sonstige Finanzdienstleistungen, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds a. n. g.	3,86 %
	Sonstige Kreditinstitute	30,83 %
	Immobilienaktivitäten	2,53 %
	Rückversicherung	0,44 %
	Vermietung und Betrieb von eigenen oder geleasteten Immobilien	0,65 %
	Vermittlung von Wertpapieren und Warentermingeschäften	0,70 %
Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	9,82 %	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Information und Kommunikation	IT-Beratungstätigkeiten	0,49 %
	Informationsdienste	0,29 %
	Programm- und Sendetätigkeit	0,42 %
	Verlagsaktivitäten	0,46 %
	Satellitenkommunikation	1,06 %
	Telekommunikation	0,95 %
	Kabelgebundene Telekommunikation	2,14 %
	Drahtlose Telekommunikation	0,38 %
Herstellung	Herstellung, Runderneuerung und Reparatur von Bereifungen	0,23 %
	Herstellung von Erfrischungsgetränken; Gewinnung natürlicher Mineralwasser und Herstellung von sonstigem abgefülltem Wasser	0,48 %
	Herstellung von Spirituosen	0,51 %
	Herstellung von pharmazeutischen Grundstoffen und pharmazeutischen Präparaten	1,13 %
	Herstellung von Lagern, Getrieben, Zahnrädern und Antriebselementen	0,27 %
	Herstellung von Getränken	1,10 %
	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	0,82 %
	Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	1,29 %
	Herstellung von Lebensmittelprodukten	0,50 %
	Herstellung von Schuhen	0,23 %
	Herstellung von Getreidemühlenprodukten	0,38 %
	Herstellung von Industriegasen	0,19 %
	Herstellung von Bestrahlungsgeräten, elektromedizinischen und elektrotherapeutischen Geräten	1,62 %
	Herstellung von Schmuck, Gold- und Silberschmiedewaren (ohne Fantasieschmuck)	0,23 %
	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	2,07 %
	Herstellung von sonstiger Oberbekleidung	0,40 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	1,42 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	1,72 %
	Mineralölverarbeitung	0,73 %
	Herstellung von Verdrahtungsgeräten	0,53 %
	Herstellung	0,23 %
	Bergbau und Steinbruch	Bergbauunterstützungsdienstleistungen
Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Tätigkeiten von Hauptniederlassungen; Managementberatungstätigkeiten	0,54 %
	Architektur- und Ingenieurleistungen; technische Tests und Analysen	0,59 %
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	Allgemeine öffentliche Verwaltung	0,00 %
Verkehr und Lagerei	Landtransport und Transport in Rohrfernleitungen	0,51 %
	Dienstleistungen für den Landverkehr	0,42 %
	Verkehr und Lagerei	1,47 %
	Lagerhaltung und unterstützende Aktivitäten für den Transport	0,50 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	0,35 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 7 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

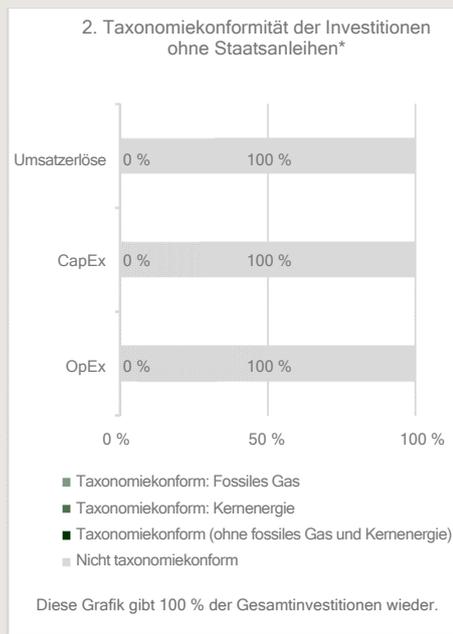
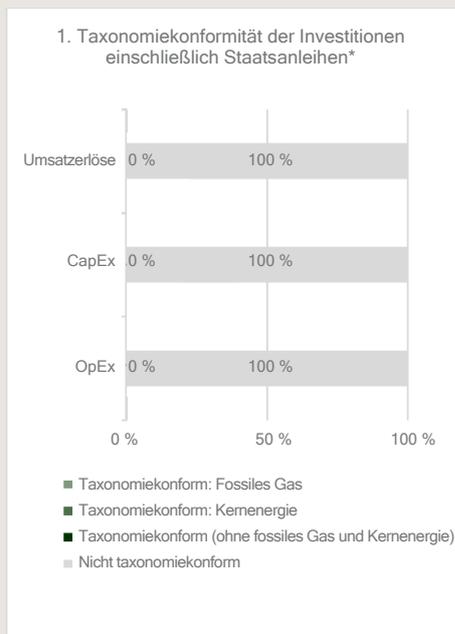
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 40 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 42 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart. Ebenfalls berücksichtigt wurden Investitionen, die aufgrund unzureichender Daten nicht als an den ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet bewertet werden können. Als Mindestschutz entsprechen diese Investitionen der JSS-Ausschlussrichtlinie und überschreiten nicht die definierten Umsatzschwellen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts verfolgte einen strengen Prozess, bei dem ESG-Aspekte durchweg integriert wurden. Der Anlageverwalter berücksichtigte die folgenden Kriterien in seiner Strategie:

(a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie. Darüber hinaus schließt das Finanzprodukt Emittenten mit unkonventionellen Öl- und Gasaktivitäten (Teersand und Fracking) aus, wenn die mit diesen Aktivitäten erwirtschafteten Erträge mehr als 5 % betragen.

(b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen. Emittenten mit einem Rating von A- oder B werden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt ist. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickeln und nicht unter die definierten Schwellenwerte fallen;

(c) Um ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erzielen, investierte dieses Produkt nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating;

(d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der nachhaltigen Entwicklungsziele (SDGs) der UN übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Equity - Europe

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300Q02Q3MPXCK2Y95

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 95 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 100 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**
Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**
Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 4,84 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 4,84 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x		x	Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der
2	CO2-Fußabdruck	x	x		x	
3	THG-Emissionsintensität	x	x		x	
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x		x	
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x		x	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x		x	<p>Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3).</p> <p>In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.</p> <p>Im Mai 2020 startete JSS ein Klimaversprechen mit dem Ziel, bis 2035 einen CO₂-neutralen Ausgang zu erreichen. Kontrollen der THG-Emissionen werden anhand des CO₂-Fußabdrucks durchgeführt und gelten für eine Untergruppe von Fonds. Das Klimaversprechen wird für die nachhaltigen Anlagestrategien umgesetzt und durch den rückwärts gerichteten Dekarbonisierungspfad verfolgt, um Übergangsrisiken zu mindern. Die Methodik definiert die Zielsetzung als eine Reduzierung des THG-Emissionen-Fußabdrucks der Benchmark um 30 %, der in den folgenden Jahren um 7 % reduziert wird. Ab 2030 reduziert sich das Ziel linear bis zum Erreichen von Netto-Null in 2035. Die THG-Emissionen des Portfolios auf Basis der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro USD Mio. EVIC ausgedrückt.</p>
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			<p>In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.</p>

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
NESTLE / ACT NOM	CH	Herstellung von Lebensmittelprodukten	5,46 %
ASML HOLDING NV	NL	Herstellung von sonstigen Sondermaschinen a. n. g.	5,07 %
LVMH ACT.	FR	Herstellung von sonstiger Oberbekleidung	4,98 %
ROCHE HOLDING AG /GENUSSSCHEIN	CH	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	3,77 %
NORDEA BANK ABP	FI	Sonstige Kreditinstitute	3,59 %
L OREAL	FR	Herstellung von Körperpflegemitteln und Duftstoffen	3,43 %
ALLIANZ SE/NAM.VINKULIERT	DE	Lebensversicherung	3,12 %
AIR LIQUIDE	FR	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	3,08 %
SCHNEIDER ELECTRIC SE	FR	Herstellung von Verdrahtungsgeräten	2,94 %
VINCI.	FR	Bau von Straßen und Autobahnen	2,76 %
NOVO NORDISK A/S /-B-	DK	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	2,68 %
ATLAS COPCO RG-A	SE	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	2,67 %
UNIV MU GR BR RG	NL	Tonaufnahmen und Musikveröffentlichungen	2,57 %
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GB	Herstellung von Papier und Papierprodukten	2,56 %
DEUTSCHE POST AG	DE	Postdienstleistungen im Rahmen universeller Dienstleistungsverpflichtung	2,53 %

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

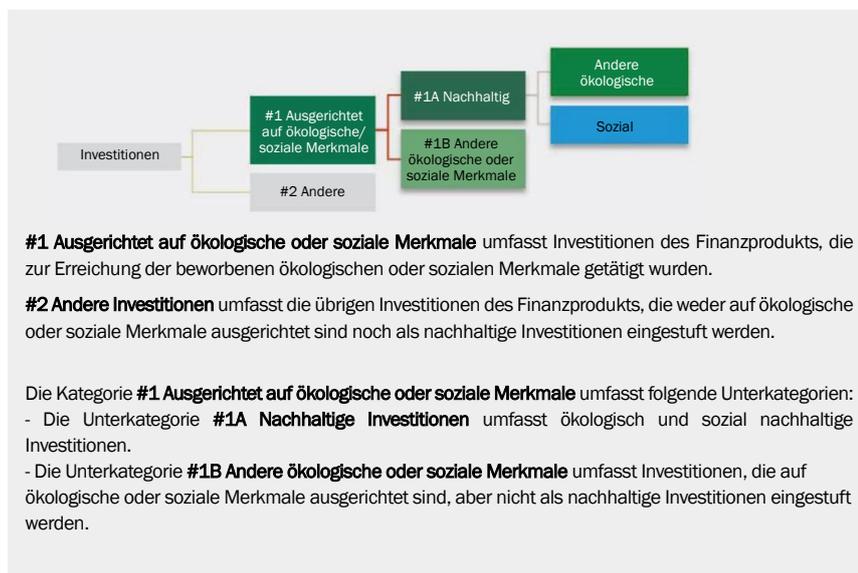
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 95 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 51 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 44 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 99 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 95 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 51 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 44 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 4 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 1 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	Sammlung nicht gefährlicher Abfälle	1,15 %
Baugewerbe	Bau von Gebäuden	1,90 %
	Bau von Straßen und Autobahnen	1,95 %
Energieversorgung	Energieversorgung	1,52 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Lebensversicherung	5,26 %
	Nichtlebensversicherung	1,42 %
	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	2,24 %
	Sonstige Kreditinstitute	7,27 %
Information und Kommunikation	IT-Beratungstätigkeiten	3,14 %
	Tonaufnahmen und Musikveröffentlichungen	2,41 %
Herstellung	Herstellung von Getränken	1,04 %
	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	3,40 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	1,92 %
	Herstellung von Wellpapier und -pappe sowie von Verpackungsmitteln aus Papier, Karton und Pappe	2,44 %
	Herstellung von Lebensmittelprodukten	5,26 %
	Herstellung von Klebstoffen	2,49 %
	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	5,28 %
	Herstellung von medizinischen und zahnmedizinischen Apparaten und Materialien	2,29 %
	Herstellung von sonstiger Oberbekleidung	5,49 %
	Herstellung von sonstigen Sondermaschinen a. n. g.	5,78 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	2,48 %
	Herstellung von Körperpflegemitteln und Duftstoffen	3,74 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	12,92 %
	Mineralölverarbeitung	2,93 %
	Herstellung von Bekleidung	1,72 %
	Herstellung von Verdrahtungsgeräten	3,53 %
	Andere Fertigung	0,92 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Bergbau und Steinbruch	Abbau von Metallerzen	2,32 %
Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Werbeagenturen	0,72 %
Verkehr und Lagerei	Postdienstleistungen im Rahmen universeller Dienstleistungsverpflichtung	2,81 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	1,85 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 5 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

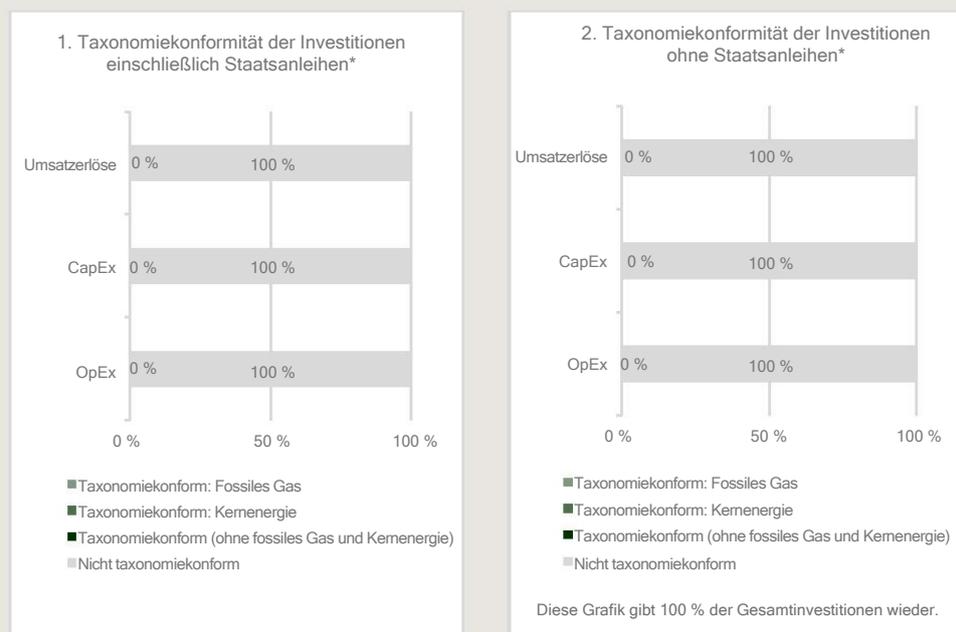
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 51 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 44 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

- (a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie;
- (b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;
- (c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert;
- (d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035

Unternehmenskennung (LEI-Code):

54930008UKU4KUKTFM60

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 49 %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 45 %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das Ziel des Produkts ist es, im Laufe der Zeit den CO₂-Fußabdruck (behauptete CO₂-Emissionen pro investierter Million USD) zu reduzieren, bis es bis 2035 im Einklang mit dem Klimaversprechen von J. Safra Sarasin („JSS“) das Netto-Null-Ziel erreicht hat. Die Methodik für den Zielsetzungsprozess leitet sich aus der Verordnung über EU-Referenzwerte für den klimabedingten Wandel ab, bei der das Ziel besteht, den CO₂-Fußabdruck (behauptete CO₂-Emissionen pro investierter Million USD) -30 % unter dem CO₂-Fußabdruck des vergleichbaren Marktes zu halten. Jedes Jahr sollte die Schwelle im Durchschnitt bis 2030 um mindestens 7 % gesenkt werden, im Einklang mit dem Dekarbonisierungskurs des Intergovernmental Panel on Climate Change (IPCC) mit dem 1,5 °C-Szenario oder darüber hinausgehend (ohne oder mit begrenztem Überschreiten). Von 2030 bis 2035 soll der CO₂-Fußabdruck des Produkts auf (Netto-)Null sinken.

Um sein Ziel zu erreichen, investierte das Produkt in „Green Champions“, also Unternehmen, die durch innovative Lösungen eine erhebliche Emissionsreduzierung ermöglichen, und in Unternehmen, die sich dem „Climate Pledge“ angeschlossen haben und entsprechend dem Übereinkommen von Paris auf dem Weg sind, die Erderwärmung auf unter 2 °C zu begrenzen. Dieser Anlageansatz ermöglichte es den Anlegern, Chancen zu nutzen und Risiken aus dem Klimawandel zu mindern. Das Portfolio bestand aus Emittenten, die auf dem Weg sind, die Erderwärmung auf unter 2 °C zu begrenzen, ein hohes Engagement in grünen Umsätzen haben und kein Engagement in Stranded Assets aufweisen. Darüber hinaus strebte das Produkt ein überdurchschnittliches Umwelt-, Sozial- oder Governance-Profil („ESG“) für das gesamte Portfolio auf der Grundlage der JSS Sustainability Matrix an. Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendants in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Genetisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);

- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Die Finanzbenchmark „5 % ICE BofA USD 3 M Deposit Bid Rate Average TR, 95 % MSCI World NR“ wird für den Vergleich und die Beurteilung der finanziellen Performance des Produkts herangezogen. Die Benchmark kann auch als Referenzwert für den Vergleich der Nachhaltigkeitsaspekte des Finanzprodukts mit dem jeweiligen Markt verwendet werden.

Dieses Finanzprodukt fällt in den Geltungsbereich des JSS Climate Pledge, das darauf abzielt, den CO₂-Fußabdruck der Anlageportfolios von JSS zu reduzieren. Zum 30.06.2023 entsprach der CO₂-Fußabdruck des Portfolios dem durch die Verpflichtung auferlegten Übergangspfad, mit einer Intensität der Kohlenstoffemissionen von 14,6 Tonnen CO₂ pro investierter Million USD im Vergleich zur Finanzbenchmark mit 43,48 Tonnen CO₂ pro investierter Million USD.

Alle Zahlen werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

- Anteil der mit A- und B-Ratings bewerteten Vermögenswerte und durchschnittliches Rating der Portfoliounternehmen: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten und resultiert in einem Punktwert von 0 (niedrig) bis 5 (hoch). Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums waren 100 % der Anlagen des Produkts mit A- bewertet und das durchschnittliche Unternehmensrating lag bei 3,4. Das durchschnittliche Unternehmensrating für die Finanzbenchmark lag bei 2,9.

- CO₂-Fußabdruck gemessen anhand der Angaben zu CO₂-Emissionen pro Million investierter USD: Am Ende des Berichtszeitraums betrug der CO₂-Fußabdruck des Produkts 14,56 Tonnen CO₂ pro investierter Million USD und die Finanzbenchmark hatte einen CO₂-Fußabdruck von 43,48 Tonnen CO₂ pro investierter Million USD.

- Grüne Einnahmen gemessen am Anteil der Einnahmen der Emittenten aus Produkten und Dienstleistungen, die eine Emissionsreduzierung durch innovative Lösungen wie erneuerbare Energien ermöglichen: Zum Ende des Berichtszeitraums lag der Anteil der grünen Einnahmen bei 28,59 %. Zum Ende desselben Zeitraums betrug der Anteil der grünen Einnahmen der Finanzbenchmark 7,47 %.

- Portfolioausrichtung auf Begrenzung der Erderwärmung auf unter 2°C: Der Temperaturanstieg des Portfolios betrug am Ende des Berichtszeitraums 1,72°C, während die Finanzbenchmark einen Anstieg von 2,74°C verzeichnete.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 4,18 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),

die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,

die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,

die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 4,18 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x		x	Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.
2	CO2-Fußabdruck	x	x		x	
3	THG-Emissionsintensität	x	x		x	
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x		x	In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x		x	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x		x	<p>Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3).</p> <p>In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.</p> <p>Im Mai 2020 startete JSS ein Klimaversprechen mit dem Ziel, bis 2035 einen CO₂-neutralen Ausgang zu erreichen. Kontrollen der THG-Emissionen werden anhand des CO₂-Fußabdrucks durchgeführt und gelten für eine Untergruppe von Fonds. Das Klimaversprechen wird für die nachhaltigen Anlagestrategien umgesetzt und durch den rückwärts gerichteten Dekarbonisierungspfad verfolgt, um Übergangsrisiken zu mindern. Die Methodik definiert die Zielsetzung als eine Reduzierung des THG-Emissionen-Fußabdrucks der Benchmark um 30 %, der in den folgenden Jahren um 7 % reduziert wird. Ab 2030 reduziert sich das Ziel linear bis zum Erreichen von Netto-Null in 2035. Die THG-Emissionen des Portfolios auf Basis der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro USD Mio. EVIC ausgedrückt.</p>
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			<p>In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.</p>

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Nebenprodukte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
MICROSOFT CORP.	USA	Sonstige Softwareveröffentlichung	5,22 %
STANTEC INC	CA	Tiefbau	3,74 %
ALPHABET INC -A-	USA	Webportale	3,43 %
SCHNEIDER ELECTRIC SE	FR	Herstellung von Verdrahtungsgeräten	3,20 %
CADENCE DESIGN SYSTEMS	USA	Verlagsaktivitäten	3,19 %
ARCH CAPITAL GP LTD BERMUDA	BM	Nichtlebensversicherung	2,98 %
MOTOROLA SOLTN/EX-DISTR	USA	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	2,76 %
COLGATE-PALMOLIVE CO.	USA	Herstellung von Papier und Papierprodukten	2,39 %
CARRIER GLOBAL CORPORATION	USA	Herstellung von Kühlungs- und Lüftungsgeräten für gewerbliche Zwecke	2,32 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

ARISTA NETWORKS INC	USA	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	2,28 %
FLEX LTD	SG	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	2,25 %
LKQ	USA	Herstellung von Kühlungs- und Lüftungsgeräten für gewerbliche Zwecke	2,24 %
FORTIVE CORP	USA	Herstellung von Mess-, Kontroll-, Navigations- und ähnlichen Instrumenten und Vorrichtungen	2,22 %
SHIMANO INC.	JP	Andere Fertigung	2,14 %
NORDEA BANK ABP	FI	Sonstige Kreditinstitute	2,11 %



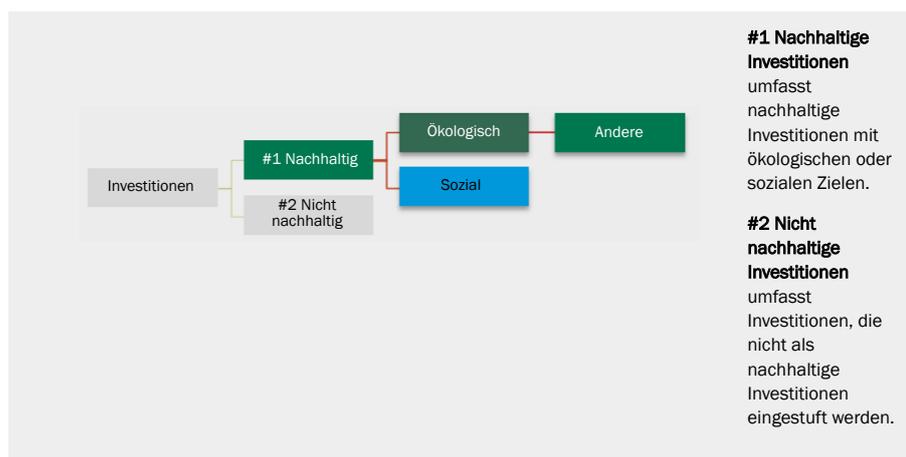
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 94 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 49 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 45 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Kategorie „#1 Nachhaltig“ bestand zu 94 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Ökologische Merkmale“ betrug 49 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 45 %. Der Anteil der unter „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ enthaltenen Anlagen betrug 6 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	Wassergewinnung, -aufbereitung und -versorgung	1,68 %
Baugewerbe	Tiefbau	4,01 %
Energieversorgung	Energieversorgung	2,16 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Lebensversicherung	2,00 %
	Nichtlebensversicherung	3,14 %
	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	3,27 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

	Sonstige Kreditinstitute	3,59 %
	Rückversicherung	1,57 %
Information und Kommunikation	Sonstige Softwareveröffentlichung	5,78 %
	Verlagsaktivitäten	5,13 %
	Webportale	3,53 %
Herstellung	Herstellung von Erfrischungsgetränken; Gewinnung natürlicher Mineralwasser und Herstellung von sonstigem abgefülltem Wasser	2,46 %
	Herstellung von pharmazeutischen Grundstoffen und pharmazeutischen Präparaten	1,85 %
	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	1,49 %
	Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	1,31 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	12,72 %
	Herstellung von elektronischen Komponenten	3,14 %
	Herstellung von Motoren und Turbinen, außer Motoren für Flugzeuge, Fahrzeuge und Fahrräder	0,97 %
	Herstellung von Mess-, Kontroll-, Navigations- und ähnlichen Instrumenten und Vorrichtungen	2,25 %
	Herstellung von Leder und verwandten Produkten	1,43 %
	Herstellung von Kraftfahrzeugen	1,48 %
	Herstellung von Kühlungs- und Lüftungsgeräten für gewerbliche Zwecke	2,40 %
	Herstellung von sonstigen chemischen Produkten a. n. g.	0,99 %
	Herstellung von sonstigen Erzeugnissen aus nichtmetallischen Mineralien a.n.g.	2,41 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	6,70 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	6,18 %
	Herstellung von Verdrahtungsgeräten	3,47 %
	Herstellung	1,73 %
	Andere Fertigung	3,36 %
Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Ingenieurbüros	1,22 %
	Sonstige Forschung und experimentelle Entwicklung in den Bereichen Naturwissenschaften und Ingenieurwesen	1,52 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	2,00 %
	Groß- und Einzelhandel und Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	2,18 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 1 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

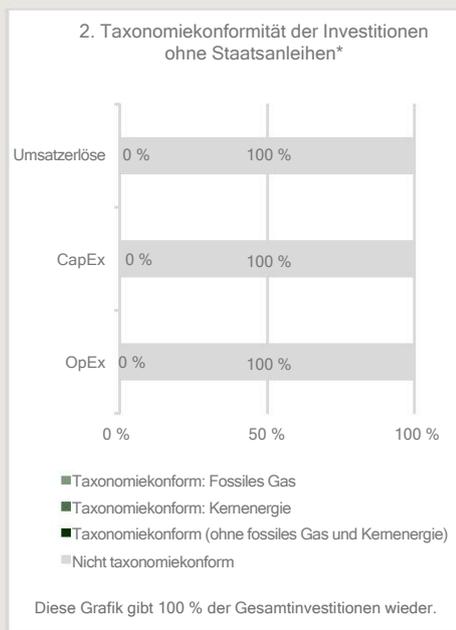
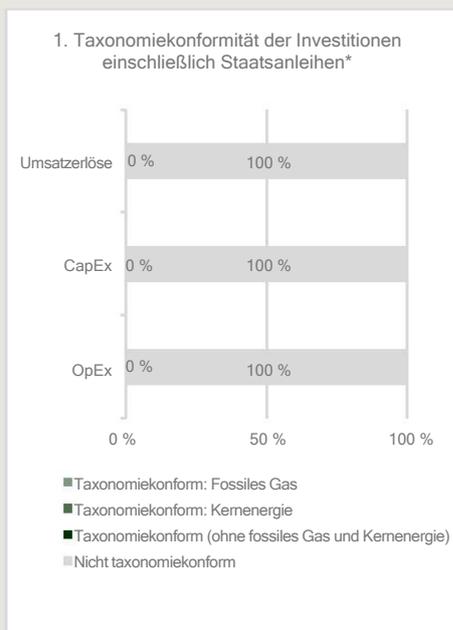
Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**
Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.
- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**
Nicht zutreffend



sind nachhaltige

Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 49 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 45 %.



Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Ebenfalls enthalten sind die übrigen Investitionen des Produkts. Diese Investitionen wurden gemäß der JSS Sustainability Matrix mit A bewertet, erfüllen jedoch nicht die Kriterien für die Einstufung als nachhaltige Investitionen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

(a) Ausschluss von Investitionen in umstrittene Geschäftsaktivitäten gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie: Zusätzlich wurden die folgenden Ausschlüsse angewendet: Teersand, Fracking und herkömmliche Kohle, Öl und Gas, wenn die mit diesen Aktivitäten erwirtschafteten Erträge mehr als 5 % betragen;

(b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;

(c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt investierte ausschließlich in Emittenten mit A-Rating. Dazu investierte das Produkt in „Green Champions“, also Unternehmen, die durch innovative Lösungen eine erhebliche Emissionsreduzierung ermöglichen, oder in „Climate Pledgers“, d. h. Unternehmen, die entsprechend dem Übereinkommen von Paris auf dem Weg sind, die Erderwärmung auf unter 2 °C zu begrenzen. Es wird erwartet, dass sich der Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten und die Verringerung des CO₂-Fußabdrucks des Portfolios im Laufe der Zeit verbessern werden;

Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter bei ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um eine Verhaltensänderung hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung des nachhaltigen Investitionsziels zu bewirken.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Bei den **Referenzwert** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Equity - Real Estate Global

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300Y84OCE7K6X4L62

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 83 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendants in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 100 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x		x	Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der
2	CO2-Fußabdruck	x	x		x	
3	THG-Emissionsintensität	x	x		x	
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x		x	
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x		x	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x		x	<p>Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3).</p> <p>In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.</p> <p>Im Mai 2020 startete JSS ein Klimaversprechen mit dem Ziel, bis 2035 einen CO2-neutralen Ausgang zu erreichen. Kontrollen der THG-Emissionen werden anhand des CO2-Fußabdrucks durchgeführt und gelten für eine Untergruppe von Fonds. Das Klimaversprechen wird für die nachhaltigen Anlagestrategien umgesetzt und durch den rückwärts gerichteten Dekarbonisierungspfad verfolgt, um Übergangsrisiken zu mindern. Die Methodik definiert die Zielsetzung als eine Reduzierung des THG-Emissionen-Fußabdrucks der Benchmark um 30 %, der in den folgenden Jahren um 7 % reduziert wird. Ab 2030 reduziert sich das Ziel linear bis zum Erreichen von Netto-Null in 2035. Die THG-Emissionen des Portfolios auf Basis der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO2e pro USD Mio. EVIC ausgedrückt.</p>
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			<p>In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.</p>

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Nebenprodukte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.
13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
PROLOGIS INC	USA	Immobilienaktivitäten	8,92 %
CTP BR RG	NL	Vermietung und Betrieb von eigenen oder geleasteten Immobilien	5,07 %
GOODMAN GROUP	AU	Immobilienaktivitäten	4,90 %
VONOVIA SE /NAMEN	DE	Vermietung und Betrieb von eigenen oder geleasteten Immobilien	4,73 %
MITSUI FUDOSAN CO	JP	Immobilienaktivitäten	4,36 %
EQUINIX INC /REIT	USA	IT-Beratungstätigkeiten	4,19 %
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ.	USA	Immobilienaktivitäten	4,02 %
MITSUBISHI ESTATE CO.	JP	Immobilienaktivitäten	4,01 %
LEG IMMOBILIEN SE	DE	Immobilienaktivitäten	3,77 %
HEALTHPEAK PROPERTIES INC /REIT	USA	Immobilienaktivitäten	3,62 %
SEGRO PLC /REIT	GB	Immobilienaktivitäten	3,61 %
MID-AMERICA APARTMENT COMMUN.	USA	Immobilienaktivitäten	3,49 %
DERWENT LONDON PLC REIT	GB	Immobilienaktivitäten	3,13 %
LINK REIT -- UNITS	HK	Immobilienaktivitäten	3,02 %
EQUITY RESIDENTIAL SBI	USA	Immobilienaktivitäten	2,98 %



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 83 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 50 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 33 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 95 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 83 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 50 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 33 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 12 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 5 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Immobilienaktivitäten	82,36 %
	Vermietung und Betrieb von eigenen oder geleasten Immobilien	9,27 %
Information und Kommunikation	IT-Beratungstätigkeiten	3,29 %

Dieses Finanzprodukt war nicht in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen engagiert.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

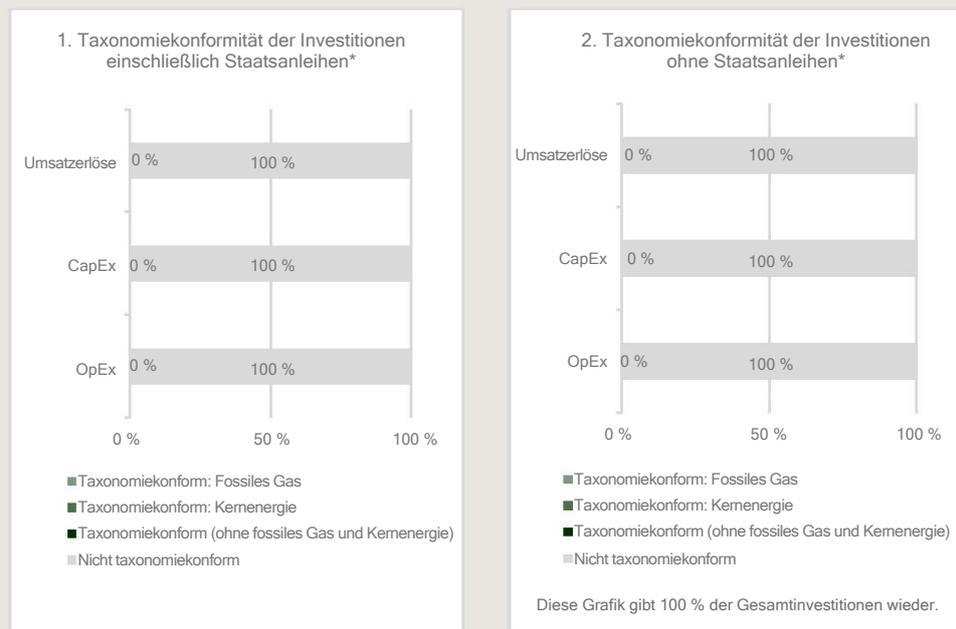
Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 50 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 33 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

- (a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie;
- (b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;
- (c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert;
- (d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Equity - USA

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493003LS78C3WGH5Z33

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 92 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 100 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**
Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**
Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 3,99 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 3,99 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x		x	<p>Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.</p> <p>In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3).</p> <p>In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine</p>
2	CO2-Fußabdruck	x	x		x	
3	THG-Emissionsintensität	x	x		x	
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x		x	
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x		x	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x		x	<p>Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.</p> <p>Im Mai 2020 startete JSS ein Klimaversprechen mit dem Ziel, bis 2035 einen CO2-neutralen Ausgang zu erreichen. Kontrollen der THG-Emissionen werden anhand des CO2-Fußabdrucks durchgeführt und gelten für eine Untergruppe von Fonds. Das Klimaversprechen wird für die nachhaltigen Anlagestrategien umgesetzt und durch den rückwärts gerichteten Dekarbonisierungspfad verfolgt, um Übergangsrisiken zu mindern. Die Methodik definiert die Zielsetzung als eine Reduzierung des THG-Emissionen-Fußabdrucks der Benchmark um 30 %, der in den folgenden Jahren um 7 % reduziert wird. Ab 2030 reduziert sich das Ziel linear bis zum Erreichen von Netto-Null in 2035. Die THG-Emissionen des Portfolios auf Basis der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO2e pro USD Mio. EVIC ausgedrückt.</p>
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			<p>In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.</p>
8	Emissionen in Wasser		x			<p>In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.</p>

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Nebenprodukte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.
13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
MICROSOFT CORP.	USA	Sonstige Softwareveröffentlichung	8,46 %
APPLE INC	USA	Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	5,77 %
ALPHABET INC -C-	USA	Webportale	4,72 %
ARCH CAPITAL GP LTD BERMUDA	BM	Nichtlebensversicherung	3,39 %
CADENCE DESIGN SYSTEMS	USA	Verlagsaktivitäten	3,23 %
PNC FINANCIAL SERVICES GP	USA	Sonstige Kreditinstitute	3,07 %
AMAZON COM INC	USA	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	2,71 %
MOTOROLA SOLTN/EX-DISTR	USA	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	2,71 %
CARRIER GLOBAL CORPORATION	USA	Herstellung von Kühlungs- und Lüftungsgeräten für gewerbliche Zwecke	2,61 %
DEERE & CO.	USA	Herstellung von Land- und Forstmaschinen	2,57 %
MONDELEZ INTERNATIONAL INC WI	USA	Herstellung von Zwieback und Keksen; Herstellung von Dauerbackwaren	2,45 %
MASTERCARD INC. SHS-A-	USA	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	2,39 %
CONOCOPHILLIPS	USA	Gewinnung von Erdöl und Erdgas	2,37 %
ARISTA NETWORKS INC	USA	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	2,35 %
APPLIED MATERIALS INC	USA	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	2,32 %

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 92 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 46 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 46 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 99 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 92 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 46 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 46 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 7 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 1 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Sonstige wirtschaftliche Dienstleistungen	Andere Reservierungsdienste und zugehörige Aktivitäten	1,57 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Nichtlebensversicherung	5,12 %
	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	3,74 %
	Sonstige Kreditinstitute	1,67 %
	Sonstige Kreditinstitute	2,44 %
	Immobilienaktivitäten	1,44 %
	Rückversicherung	1,50 %
	Information und Kommunikation	Sonstige Softwareveröffentlichung
Verlagsaktivitäten		5,73 %
Veröffentlichung von Computerspielen		1,92 %
Webportale		4,98 %
Herstellung	Herstellung von Zwieback und Keksen; Herstellung von Dauerbackwaren	2,42 %
	Herstellung von Erfrischungsgetränken; Gewinnung natürlicher Mineralwasser und Herstellung von sonstigem abgefülltem Wasser	2,47 %
	Herstellung von Land- und Forstmaschinen	2,35 %
	Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	6,39 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	12,73 %
	Herstellung von Leder und verwandten Produkten	1,48 %
	Herstellung von Kühlungs- und Lüftungsgeräten für gewerbliche Zwecke	2,70 %
	Herstellung von sonstigen Erzeugnissen aus nichtmetallischen Mineralien a.n.g.	2,30 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	3,16 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	5,84 %
	Herstellung	2,85 %
	Andere Fertigung	1,33 %
	Bergbau und Steinbruch	Gewinnung von Erdöl und Erdgas

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Sonstige Forschung und experimentelle Entwicklung in den Bereichen Naturwissenschaften und Ingenieurwesen	3,39 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	2,92 %
	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	1,96 %
	Groß- und Einzelhandel und Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	1,94 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 4 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

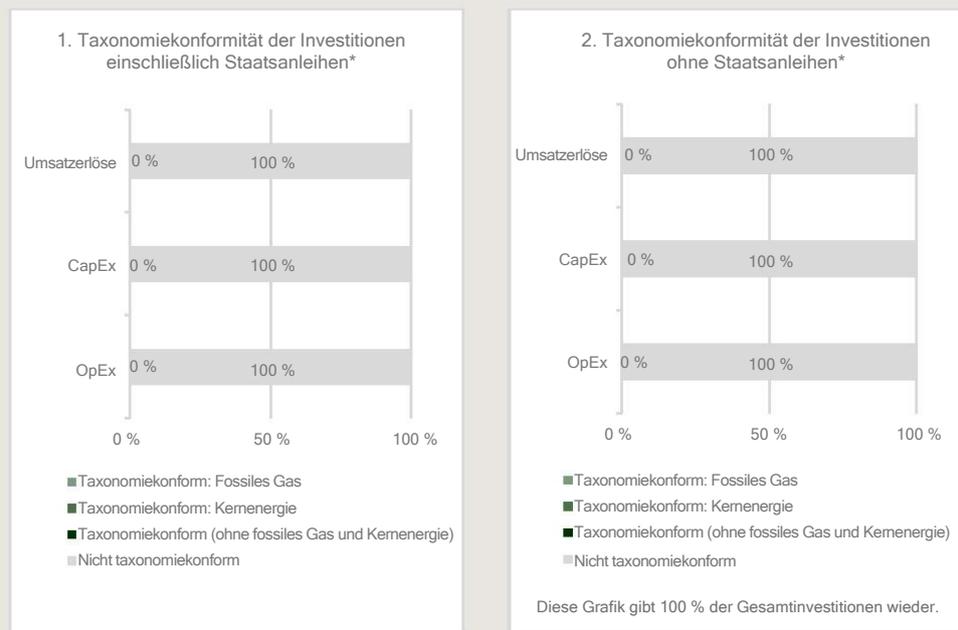
Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 46 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 46 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

(A) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie;

(b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;

(c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert;

Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300TS1TXQUMDN1071

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 93 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 100 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**
Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**
Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x			Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3). In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.
2	CO2-Fußabdruck	x	x			
3	THG-Emissionsintensität	x	x			
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x			
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x			
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x			
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Nebenprodukte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
AUS 1,5 % NOTES 21.6.31 1,75 %	AU	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	5,80 %
JSS IN SUEQ SEM SHS I USD ACC CAP	LU	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	4,71 %
DEUTSCHLAND 0 % 22- 20.09.23 TB	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	2,70 %
DEUTSCHLAND 0 % 22- 22.11.23 TB	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	2,49 %
AUSTRALIA 1,25 % 19- 21.05.32	AU	Allgemeine öffentliche Verwaltung	1,88 %
SK HYNIX 3 % 19-17.09.24	KR	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	1,00 %
RURAL ELEC 3,50 % 19- 12.12.24	IN	Finanzierungsleasing	0,90 %
HAITONG INT 3,375 % 19- 19.07.24	BM	Vermittlung von Wertpapieren und Waretermingeschäften	0,85 %
SK BRDBAND 3,875 % 18- 13.08.23	KR	Herstellung	0,82 %
LG CHEM 3,25 % 19-15.10.24	KR	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	0,81 %
DEUTSCHLAND 0 % 23- 17.01.24 TB	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	0,81 %

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

HKT CAPITAL 3,625 % 15-02.04.25	VG	Kabelgebundene Telekommunikation	0,80 %
DEUTSCHLAND 0 % 23-20.03.24 TB	DE	Allgemeine öffentliche Verwaltung	0,80 %
VMWARE INC 3,9 % 17-21.08.27	USA	Verlagsaktivitäten	0,78 %
BANK MANDIR 3,75 % 19-11.04.24	ID	Sonstige Kreditinstitute	0,76 %



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 93 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 46 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 47 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 97 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 93 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 46 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 47 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 4 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der Investitionen der Kategorie „#2 Andere“ betrug 3 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Gastgewerbe	Gastronomie	0,09 %
Sonstige wirtschaftliche Dienstleistungen	Tätigkeiten von Inkassobüros und Auskunfteien	0,23 %
	Tätigkeiten von Arbeitsvermittlungsagenturen	0,14 %
	Andere Reservierungsdienste und zugehörige Aktivitäten	0,32 %
	Vermietung und Verpachtung	0,77 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Kunst, Unterhaltung und Erholung	Spiel-, Wett- und Lotteriewesen	0,09 %
Baugewerbe	Tiefbau	0,09 %
	Bau von Gebäuden	0,12 %
Energieversorgung	Verteilung gasförmiger Brennstoffe durch Rohrleitungen	0,60 %
	Energieversorgung	1,15 %
	Handel mit Elektrizität	0,23 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	1,02 %
	Tätigkeiten von Versicherungsmaklerinnen und -maklern	0,66 %
	Verwaltung der Finanzmärkte	0,54 %
	Central Banking	0,13 %
	Finanzierungsleasing	0,81 %
	Fondsmanagementaktivitäten	1,17 %
	Lebensversicherung	0,72 %
	Verwaltung von Immobilien auf Honorar- oder Vertragsbasis	0,09 %
	Nichtlebensversicherung	1,69 %
	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	1,22 %
	Sonstige Kreditinstitute	1,03 %
	Sonstige Kreditinstitute	11,97 %
	Immobilienaktivitäten	1,07 %
	Vermietung und Betrieb von eigenen oder geleasteten Immobilien	0,71 %
	Vermittlung von Wertpapieren und Warentermingeschäften	0,78 %
	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	4,91 %
	Gesundheits- und Sozialwesen	Arztpraxen für Allgemeinmedizin
Tätigkeiten im Gesundheitswesen		0,67 %
Sonstige Tätigkeiten im Gesundheitswesen		0,13 %
Information und Kommunikation	IT-Beratungstätigkeiten	0,95 %
	Computerprogrammierungstätigkeiten	0,65 %
	Computerprogrammierung, Beratung und damit verbundene Aktivitäten	0,94 %
	Informationsdienste	1,25 %
	Sonstiges Verlagswesen	0,51 %
	Sonstige Softwareveröffentlichung	0,70 %
	Programm- und Sendetätigkeit	0,47 %
	Verlagsaktivitäten	3,58 %
	Veröffentlichung von Computerspielen	0,32 %
	Tonaufnahmen und Musikveröffentlichungen	0,10 %
	Telekommunikation	2,69 %
	Webportale	0,38 %
	Kabelgebundene Telekommunikation	1,18 %
	Drahtlose Telekommunikation	0,94 %
Herstellung	Herstellung von Zwieback und Keksen; Herstellung von Dauerbackwaren	0,22 %
	Herstellung von Erfrischungsgetränken; Gewinnung natürlicher Mineralwasser und Herstellung von sonstigem abgefülltem Wasser	0,09 %
	Herstellung von pharmazeutischen Grundstoffen und pharmazeutischen Präparaten	0,59 %
	Herstellung von Getränken	1,14 %
	Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten	1,67 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

	Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	0,59 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	3,95 %
	Herstellung von Computern und peripheren Geräten	0,28 %
	Herstellung von elektronischen Komponenten	2,14 %
	Herstellung von Motoren und Turbinen, außer Motoren für Flugzeuge, Fahrzeuge und Fahrräder	0,22 %
	Herstellung von Metallerzeugnissen, ausgenommen Maschinen und Anlagen	0,22 %
	Herstellung von Lebensmittelprodukten	1,23 %
	Herstellung von Getreidemühlenprodukten	0,84 %
	Herstellung von Industriegasen	0,33 %
	Herstellung von Mess-, Kontroll-, Navigations- und ähnlichen Instrumenten und Vorrichtungen	0,14 %
	Herstellung von Leder und verwandten Produkten	0,09 %
	Herstellung von Hebezeugen und Fördermitteln	0,09 %
	Herstellung von Koffern, Taschen und ähnliche Waren, und Sattlerwaren	0,46 %
	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	2,54 %
	Herstellung von medizinischen und zahnmedizinischen Apparaten und Materialien	0,10 %
	Herstellung von Kraftfahrzeugen	0,53 %
	Herstellung von Kraftwagen, Anhängern und Sattelanhängern	1,37 %
	Herstellung von sonstigen Erzeugnissen aus nichtmetallischen Mineralien a.n.g.	0,15 %
	Herstellung von sonstiger Oberbekleidung	0,33 %
	Herstellung von sonstigen Sondermaschinen a. n. g.	0,32 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	0,62 %
	Herstellung von Körperpflegemitteln und Duftstoffen	0,23 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	3,05 %
	Herstellung von Kunststoffen in Primärformen	0,22 %
	Mineralölverarbeitung	0,23 %
	Herstellung von Seifen, Wasch-, Reinigungs- und Poliermitteln	0,80 %
	Herstellung von Textilien	0,13 %
	Herstellung von Bekleidung	0,54 %
	Herstellung von Verdrahtungsgeräten	0,68 %
	Herstellung	2,53 %
	Andere Fertigung	1,17 %
	Herstellung von Schleifmitteln	0,13 %
Bergbau und Steinbruch	Gewinnung von Erdöl und Erdgas	1,25 %
	Abbau von Metallerzen	0,39 %
	Bergbauunterstützungsdienstleistungen	0,47 %
Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Rechnungswesen, Buchführung und Wirtschaftsprüfung; Steuerberatung	0,09 %
	Tätigkeiten von Hauptniederlassungen; Managementberatungstätigkeiten	0,32 %
	Werbung und Marktforschung	0,22 %
	Architektur- und Ingenieurstätigkeiten; technische Tests und Analysen	0,09 %
	Rechtliche und Rechnungslegungstätigkeiten	0,09 %
	Sonstige Forschung und experimentelle Entwicklung in den Bereichen Naturwissenschaften und Ingenieurwesen	0,13 %
	Wissenschaftliche Forschung und Entwicklung	0,43 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	Allgemeine öffentliche Verwaltung	2,58 %
	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	4,11 %
Verkehr und Lagerei	Landtransport und Transport in Rohrfernleitungen	0,83 %
	Lagerhaltung und unterstützende Aktivitäten für den Transport	0,18 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Apotheker in Fachgeschäften	0,12 %
	Sonstiger Einzelhandel	0,09 %
	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	1,29 %
	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	3,49 %
	Groß- und Einzelhandel und Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	1,06 %
	Großhandel mit Holz, Baustoffen und Sanitärbedarf	0,14 %
	Großhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	1,23 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 6 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

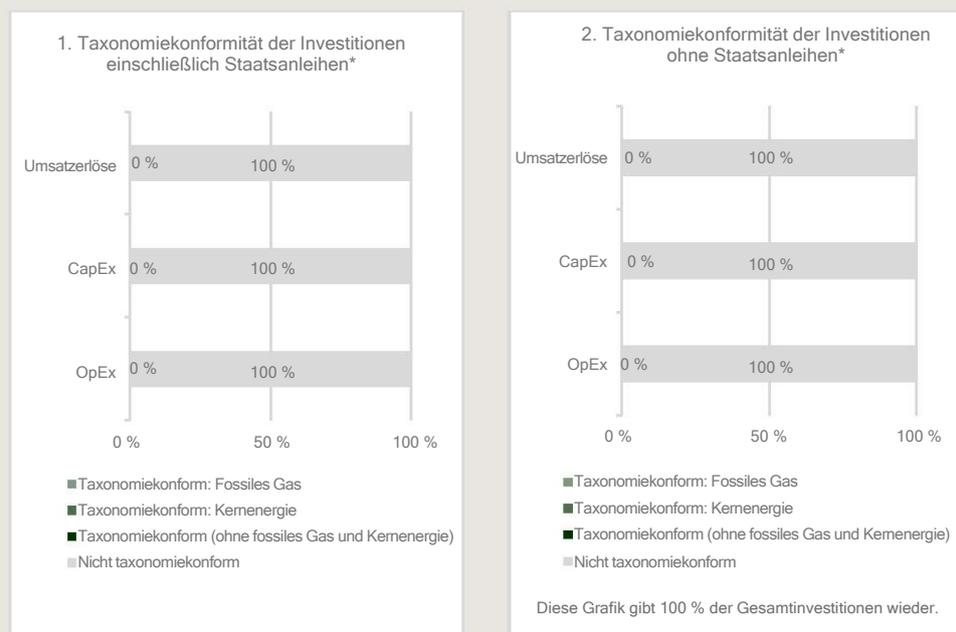
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 46 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 47 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

- (A) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie;
- (b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;
- (c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert;

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Equity - Green Planet

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300CV5RVE3YTN2353

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 61 %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 36 %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Ziel des Produkts ist es, den Übergang zu einer grünen Wirtschaft zu unterstützen, indem es in Unternehmen investiert, die zur Entwicklung umweltfreundlicher Lösungen beitragen.

Zu diesem Zweck investierte das Produkt in „Green Winners“, d. h. in Unternehmen, die Lösungen für wichtige Umweltprobleme bieten, denen sich unser Planet heute gegenübersehen, sowie in Unternehmen in der Anfangsphase, die bahnbrechende Umwelttechnologien entwickeln. Das Produkt richtete seinen Fokus auf Unternehmen mit einem Engagement in „grünen“ Einnahmen. Das Produkt strebte an, einen durchschnittlichen Anteil von „grünen Einnahmen“ am Gesamtumsatz des Portfolios von 30 % zu erreichen. Das Finanzprodukt zielte darauf ab, zu einer Reihe von Umweltzielen beizutragen, wie Klimaschutz, Anpassung an den Klimawandel, nachhaltige Nutzung und Schutz von Wasser- und Meeresressourcen, Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft, Vermeidung und Verminderung der Umweltverschmutzung und Schutz und Wiederherstellung der Biodiversität und der Ökosysteme.

Darüber hinaus strebte das Produkt ein überdurchschnittliches Umwelt-, Sozial- oder Governance-Profil („ESG“) für das gesamte Portfolio auf der Grundlage der JSS Sustainability Matrix an. Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);

- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);

- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);

- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);

- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);

- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);

- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);

- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

- Anteil der mit A- und B-Ratings bewerteten Vermögenswerte und durchschnittliches Rating der Portfoliounternehmen: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten und resultiert in einem Punktwert von 0 (niedrig) bis 5 (hoch). Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums waren 91 % der Anlagen des Produkts mit A- bewertet und das durchschnittliche Unternehmensrating lag bei 3,4. Das durchschnittliche Unternehmensrating für die Finanzbenchmark lag bei 2,9.

- CO₂-Fußabdruck gemessen anhand der Angaben zu CO₂-Emissionen pro investierter Million USD. Im Berichtszeitraum betrug der CO₂-Fußabdruck 61,65 Tonnen CO₂ pro investierter Million USD. Im gleichen Zeitraum verzeichnete die Finanzbenchmark einen CO₂-Fußabdruck von 43,48 Tonnen CO₂ pro investierter Million USD.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

- Grüne Einnahmen gemessen am Anteil der Einnahmen der Emittenten aus Produkten und Dienstleistungen, die eine Emissionsreduzierung durch innovative Lösungen wie erneuerbare Energien ermöglichen. Im Berichtszeitraum lag der Anteil der grünen Einnahmen bei 47,45 %. Im gleichen Zeitraum betrug der Anteil der grünen Einnahmen der Finanzbenchmark 7,47 %.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend

● Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 4,18 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),

die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,

die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,

die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 4,18 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x		x	<p>Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.</p> <p>In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3).</p> <p>In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.</p> <p>Im Mai 2020 startete JSS ein Klimaversprechen mit dem Ziel, bis 2035 einen CO₂-neutralen Ausgang zu erreichen. Kontrollen der THG-Emissionen werden anhand des CO₂-Fußabdrucks durchgeführt und gelten für eine Untergruppe von Fonds. Das Klimaversprechen wird für die nachhaltigen Anlagestrategien umgesetzt und durch den</p>
2	CO ₂ -Fußabdruck	x	x		x	
3	THG-Emissionsintensität	x	x		x	
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x		x	
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x		x	
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x		x	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

						rückwärts gerichteten Dekarbonisierungspfad verfolgt, um Übergangsrisiken zu mindern. Die Methodik definiert die Zielsetzung als eine Reduzierung des THG-Emissionen-Fußabdrucks der Benchmark um 30 %, der in den folgenden Jahren um 7 % reduziert wird. Ab 2030 reduziert sich das Ziel linear bis zum Erreichen von Netto-Null in 2035. Die THG-Emissionen des Portfolios auf Basis der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO2e pro USD Mio. EVIC ausgedrückt.
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.
8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.
13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
REPUBLIC SERVICES INC.	USA	Abfallsammlung, -Behandlung und -Entsorgung; Materialrückgewinnung	4,49 %
DANAHER CORP	USA	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	3,63 %
MICROSOFT CORP.	USA	Sonstige Softwareveröffentlichung	3,52 %
ON SEMICONDUCTOR CORP	USA	Herstellung von elektronischen Komponenten	3,38 %
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USA	Herstellung von Bestrahlungsgeräten, elektromedizinischen und elektrotherapeutischen Geräten	3,37 %
AMERICAN WATER WORKS CO INC	USA	Wassergewinnung, -aufbereitung und -versorgung	3,18 %
CLEAN HARBORS INC	USA	Abfallsammlung, -Behandlung und -Entsorgung; Materialrückgewinnung	3,07 %
ROPER TECHNOLOGIES INC	USA	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	3,01 %
METSO OUTOTEC RG REGISTERED SHS	FI	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	3,01 %
SIEMENS AG /NAM.	DE	Herstellung von Motoren und Turbinen, außer Motoren für Flugzeuge, Fahrzeuge und Fahrräder	2,95 %
VEOLIA ENVIRONNEMENT	FR	Wassergewinnung, -aufbereitung und -versorgung	2,94 %
PTC INC SHS	USA	Verlagsaktivitäten	2,76 %
STANTEC INC	CA	Tiefbau	2,64 %
VALMONT IND.INC	USA	Herstellung von Metallerzeugnissen, ausgenommen Maschinen und Anlagen	2,47 %
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	GB	Herstellung von Getränken	2,40 %



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

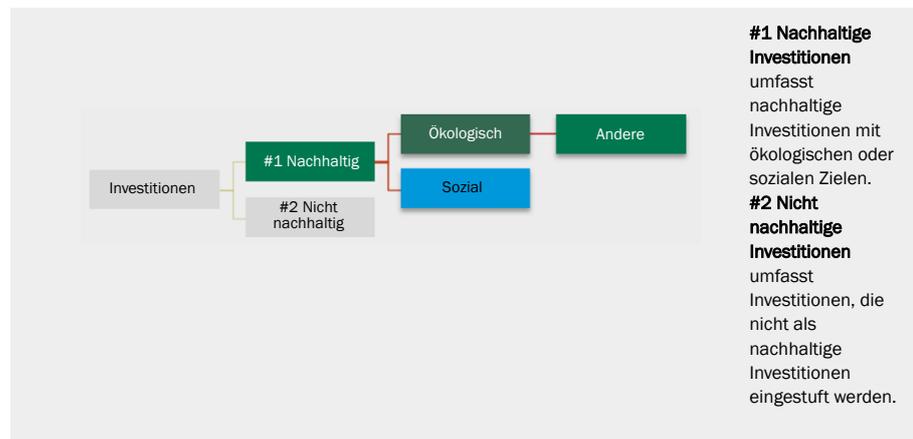
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 97 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 61 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 36 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Kategorie „#1 Nachhaltig“ bestand zu 97 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Ökologische Merkmale“ betrug 61 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 36 %. Der Anteil der unter „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ enthaltenen Anlagen betrug 3 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	Abfallsammlung, -Behandlung und -Entsorgung; Materialrückgewinnung	7,83 %
	Wassergewinnung, -aufbereitung und -versorgung	6,77 %
Gastgewerbe	Gastgewerbe	0,20 %
Baugewerbe	Tiefbau	4,78 %
Energieversorgung	Energieversorgung	4,39 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Sonstige Kreditinstitute	0,00 %
Information und Kommunikation	Sonstige Softwareveröffentlichung	4,83 %
	Verlagsaktivitäten	2,84 %
Herstellung	Herstellung von Getränken	2,44 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	9,55 %
	Herstellung von elektronischen Komponenten	10,63 %
	Herstellung von Motoren und Turbinen, außer Motoren für Flugzeuge, Fahrzeuge und Fahrräder	4,47 %
	Herstellung von Metallerzeugnissen, ausgenommen Maschinen und Anlagen	1,92 %
	Herstellung von Lebensmittelprodukten	1,06 %
	Herstellung von Klebstoffen	1,43 %
	Herstellung von Bestrahlungsgeräten, elektromedizinischen und elektrotherapeutischen Geräten	2,80 %
	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	17,64 %
	Herstellung sonstiger Werkzeugmaschinen	0,50 %
	Herstellung von sonstigen Teilen und Zubehör für Kraftfahrzeuge	0,74 %
	Herstellung von Gummi- und Kunststoffprodukten	1,66 %
	Herstellung von Seifen, Wasch-, Reinigungs- und Poliermitteln	1,95 %
	Herstellung	0,15 %
Bergbau und Steinbruch	Abbau von Metallerzen	1,00 %
	Abbau von sonstigen Nichteisenmetallerzen	1,34 %
	Bergbauunterstützungsdienstleistungen	0,78 %
Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Architektur- und Ingenieur Tätigkeiten; technische Tests und Analysen	1,94 %
	Ingenieurbüros	1,96 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	1,19 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 6 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

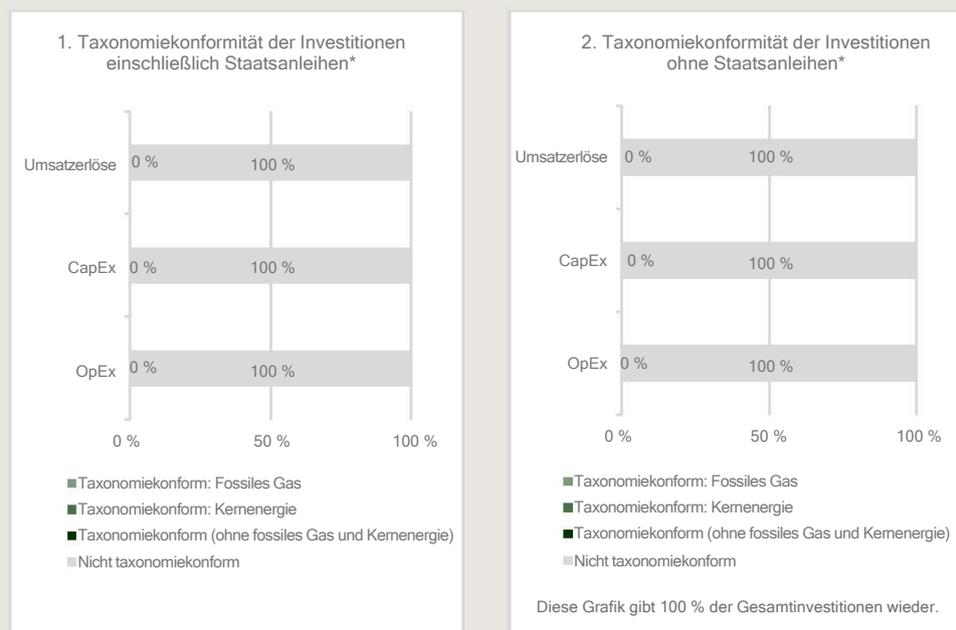
Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**
Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.
- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**
Nicht zutreffend



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 61 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 36 %.



Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Ebenfalls enthalten sind die übrigen Investitionen des Produkts. Diese Investitionen wurden gemäß der JSS Sustainability Matrix mit A bewertet, erfüllen jedoch nicht die Kriterien für die Einstufung als nachhaltige Investitionen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

(a) Ausschluss von Investitionen in umstrittene Geschäftsaktivitäten gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie.

(b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen. Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickeln und nicht unter die definierten Schwellenwerte fallen;

(c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte ausschließlich in Emittenten mit A-Rating. Das Produkt richtete seinen Fokus auf Unternehmen mit einem Engagement in „grünen“ Einnahmen. Das Konzept der grünen Einnahmen basiert auf Daten von Dritten, die JSS einholt und kuratiert, sowie auf internen Recherchen;

(d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der nachhaltigen Entwicklungsziele (SDGs) der UN übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter bei ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um eine Verhaltensänderung hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung des nachhaltigen Investitionsziels zu bewirken.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Bei den **Referenzwerter** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Bond - Total Return Global

Unternehmenskennung (LEI-Code):

222100J1DCHVW8IPFU12

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 52 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 45 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating und 49 % der Anlagen des Produkts ein B-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x			<p>Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.</p> <p>In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3).</p> <p>In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.</p> <p>In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.</p>
2	CO2-Fußabdruck	x	x			
3	THG-Emissionsintensität	x	x			
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x			
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x			
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x			
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Nebenprodukte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
SINGAPORE 1,625 % 21-01.07.31	SG	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	6,02 %
AUSTRALIA 1 % 19-21.12.30	AU	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	5,71 %
AUSTRALIA 1 % 21.11.31	AU	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	5,57 %
USA 1,125 % 20-15.05.40 /TBO	USA	Allgemeine öffentliche Verwaltung	4,42 %
USA 1,25 % 21-30.06.28 /TBO	USA	Allgemeine öffentliche Verwaltung	3,22 %
USA 0,875 % 20-15.11.30 /TBO	USA	Allgemeine öffentliche Verwaltung	3,15 %
AUSTRALIA 3,75 % 14-21.04.37	AU	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,86 %
USA 1,625 % 19-30.11.26 /TBO	USA	Allgemeine öffentliche Verwaltung	2,78 %
USA 0,50 % 20-30.06.27 /TBO	USA	Allgemeine öffentliche Verwaltung	2,56 %
USA 2,375 % 22-15.02.42 /TBO	USA	Allgemeine öffentliche Verwaltung	2,21 %
SINGAPORE 2,125 % 16-01.06.26	SG	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,96 %

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden: 01.07.2022 – 30.06.2023

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

NORWEGIAN G 1,25 % 21-17.09.31	NO	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,79 %
NORWEGIAN G 1,375 % 20-19.08.30	NO	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,78 %
AUSTRALIA 1,25 % 19-21.05.32	AU	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,59 %
AUSTRALIA 2,75 % 18-21.05.41	AU	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,48 %



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 52 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 27 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 25 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 91 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 52 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 27 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 25 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 39 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 8 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Gastgewerbe	Gastgewerbe	0,55 %
Aktivitäten extraterritorialer Organisationen und Körperschaften	Aktivitäten extraterritorialer Organisationen und Körperschaften	1,60 %
Kunst, Unterhaltung und Erholung	Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,00 %
Baugewerbe	Bau von Versorgungsprojekten für Strom und Telekommunikation	0,22 %
Energieversorgung	Energieversorgung	1,81 %
	Stromerzeugung	0,78 %
	Übertragung von Elektrizität	0,28 %

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	3,51 %
	Finanzierungsleasing	0,42 %
	Lebensversicherung	0,69 %
	Nichtlebensversicherung	0,70 %
	Sonstige Kreditinstitute	2,48 %
	Sonstige Finanzdienstleistungen, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds a. n. g.	0,30 %
	Sonstige Kreditinstitute	0,98 %
	Immobilienaktivitäten	0,16 %
	Rückversicherung	0,68 %
	Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	1,05 %
	Information und Kommunikation	Informationsdienste
Herstellung, Verleih und Vertrieb von Filmen und Fernsehprogrammen; Kinos; Tonstudios und Verlegen von Musik		0,32 %
Sonstiges Verlagswesen		0,97 %
Sonstige Softwareveröffentlichung		0,46 %
Programm- und Sendetätigkeit		0,25 %
Verlagsaktivitäten		0,45 %
Telekommunikation		1,31 %
Kabelgebundene Telekommunikation		0,34 %
Drahtlose Telekommunikation		1,28 %
Herstellung		Herstellung von Chemikalien und chemischen Produkten
	Herstellung von Koks und raffinierten Erdölerzeugnissen	0,99 %
	Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	0,19 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	0,68 %
	Herstellung von Lebensmittelprodukten	1,43 %
	Herstellung von Obst und Gemüsesäften	0,30 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	1,37 %
	Herstellung von Kunststoffen in Primärformen	0,47 %
Bergbau und Steinbruch	Gewinnung von Erdöl und Erdgas	0,69 %
	Bergbauunterstützungsdienstleistungen	2,99 %
Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Architektur- und Ingenieur Tätigkeiten; technische Tests und Analysen	0,24 %
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	Allgemeine öffentliche Verwaltung	26,91 %
	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	34,69 %
Verkehr und Lagerei	Sonstige Post-, Kurier- und Expressdienste	0,28 %
	Personenluftverkehr	0,24 %
	Transport in Rohrfernleitungen	0,22 %
	Verkehr und Lagerei	0,69 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Apotheker in Fachgeschäften	0,11 %
	Einzelhandel in nicht spezialisierten Geschäften, in denen Lebensmittel, Getränke oder Tabak überwiegen	0,56 %
	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	1,01 %
	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	0,23 %

Das Engagement dieses Finanzprodukts in fossilen Brennstoffen betrug 9 %.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

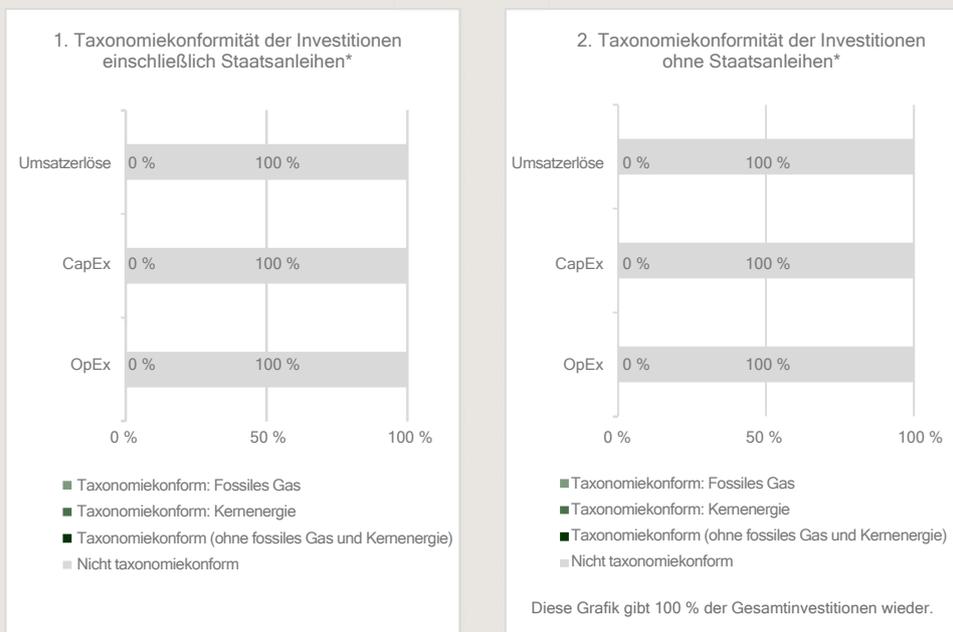
Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 27 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 25 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart. Ebenfalls berücksichtigt wurden Investitionen, die aufgrund unzureichender Daten nicht als an den ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet bewertet werden können. Als Mindestschutz entsprechen diese Investitionen der JSS-Ausschlussrichtlinie und überschreiten nicht die definierten Umsatzschwellen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

(a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie;

(b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;

(c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert;

Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300YICDN2YHCAFG20

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 86 % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 83 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating und 17 % der Anlagen des Produkts ein B-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 4,18 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 4,18 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x		x	<p>Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.</p> <p>In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3).</p> <p>In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.</p> <p>Im Mai 2020 startete JSS ein Klimaversprechen mit dem Ziel, bis 2035 einen CO₂-neutralen Ausgang zu erreichen. Kontrollen der THG-Emissionen werden anhand des CO₂-Fußabdrucks durchgeführt und gelten für eine Untergruppe von Fonds. Das Klimaversprechen wird für die nachhaltigen Anlagestrategien umgesetzt und durch den rückwärts gerichteten Dekarbonisierungspfad verfolgt,</p>
2	CO ₂ -Fußabdruck	x	x		x	
3	THG-Emissionsintensität	x	x		x	
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x		x	
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x		x	
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x			

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

						um Übergangsrisiken zu mindern. Die Methodik definiert die Zielsetzung als eine Reduzierung des THG-Emissionen-Fußabdrucks der Benchmark um 30 %, der in den folgenden Jahren um 7 % reduziert wird. Ab 2030 reduziert sich das Ziel linear bis zum Erreichen von Netto-Null in 2035. Die THG-Emissionen des Portfolios auf Basis der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO ₂ e pro USD Mio. EVIC ausgedrückt.
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.
8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Produkte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.
13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
LVMH ACT.	FR	Herstellung von sonstiger Oberbekleidung	6,75 %
AMAZON COM INC	USA	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	4,66 %
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	USA	Gastronomie	4,42 %
MICROSOFT CORP.	USA	Sonstige Softwareveröffentlichung	4,28 %
CIE FINANCIERE RICHEMONT NAM-AK	CH	Herstellung von Bekleidung	4,10 %
HERMES INTERNATIONAL	FR	Herstellung von Bekleidung	3,57 %
MASTERCARD INC. SHS-A-	USA	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	3,38 %
ELECTRONIC ARTS	USA	Verlagsaktivitäten	3,35 %
PLANET FITNESS INC	USA	Sportliche Aktivitäten, Unterhaltung und Freizeitaktivitäten	3,18 %
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	GB	Beherbergung	3,16 %
ACTIVISION BLIZZARD INC	USA	Veröffentlichung von Computerspielen	2,98 %
NESTLE / ACT NOM	CH	Herstellung von Lebensmittelprodukten	2,94 %
L OREAL	FR	Herstellung von Körperpflegemitteln und Duftstoffen	2,87 %
ALPHABET INC -A-	USA	Webportale	2,84 %
HALEON RG	GB	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	2,61 %

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

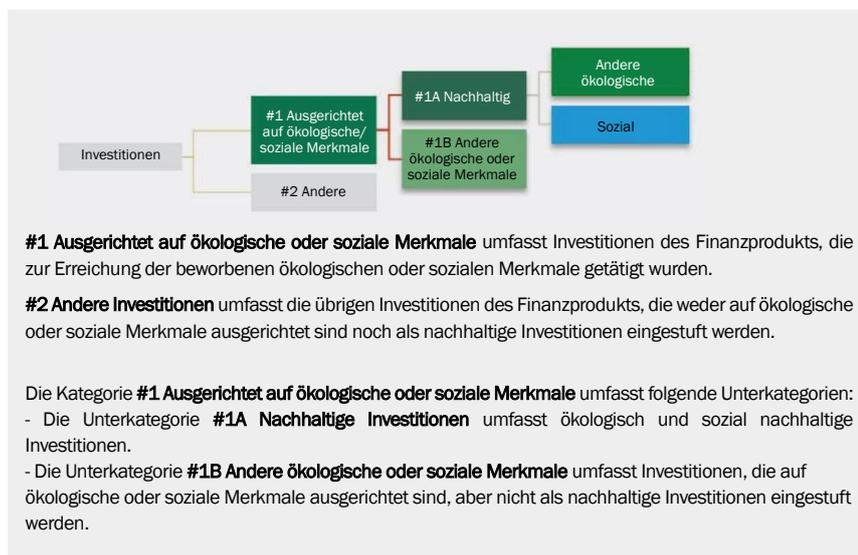
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 86 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 40 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 46 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 95 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 86 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 40 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 46 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 9 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 5 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**
Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Gastgewerbe	Beherbergung	2,60 %
	Gastronomie	4,20 %
Sonstige wirtschaftliche Dienstleistungen	Andere Reservierungsdienste und zugehörige Aktivitäten	2,32 %
Kunst, Unterhaltung und Erholung	Sportliche Aktivitäten, Unterhaltung und Freizeitaktivitäten	6,12 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Sonstige mit Finanzdienstleistungen verbundene Tätigkeiten, ausgenommen Versicherungen und Pensionsfonds	3,57 %
Information und Kommunikation	Sonstiges Verlagswesen	1,79 %
	Sonstige Softwareveröffentlichung	5,74 %
	Verlagsaktivitäten	3,37 %
	Veröffentlichung von Computerspielen	3,09 %
	Tonaufnahmen und Musikveröffentlichungen	1,73 %
	Webportale	2,78 %
Herstellung	Herstellung von Spirituosen	2,25 %
	Herstellung von Getränken	0,64 %
	Herstellung von elektronischen Komponenten	6,26 %
	Herstellung von Lebensmittelprodukten	2,75 %
	Herstellung von Leder und verwandten Produkten	2,25 %
	Herstellung von medizinischen und zahnmedizinischen Apparaten und Materialien	2,38 %
	Herstellung von Kraftwagen, Anhängern und Sattelanhängern	2,65 %
	Herstellung von sonstigen chemischen Produkten a. n. g.	1,86 %
	Herstellung von sonstiger Oberbekleidung	6,38 %
	Herstellung von Papier und Papierprodukten	1,46 %
	Herstellung von Körperpflegemitteln und Duftstoffen	2,95 %
	Herstellung von pharmazeutischen Präparaten	3,95 %
	Herstellung von Sportgeräten	0,50 %
	Herstellung von Bekleidung	12,93 %
Andere Fertigung	1,33 %	
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	5,33 %
	Einzelhandel, ohne Handel mit Kraftfahrzeugen und Motorrädern	1,78 %

Dieses Finanzprodukt war nicht in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen engagiert.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichte Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

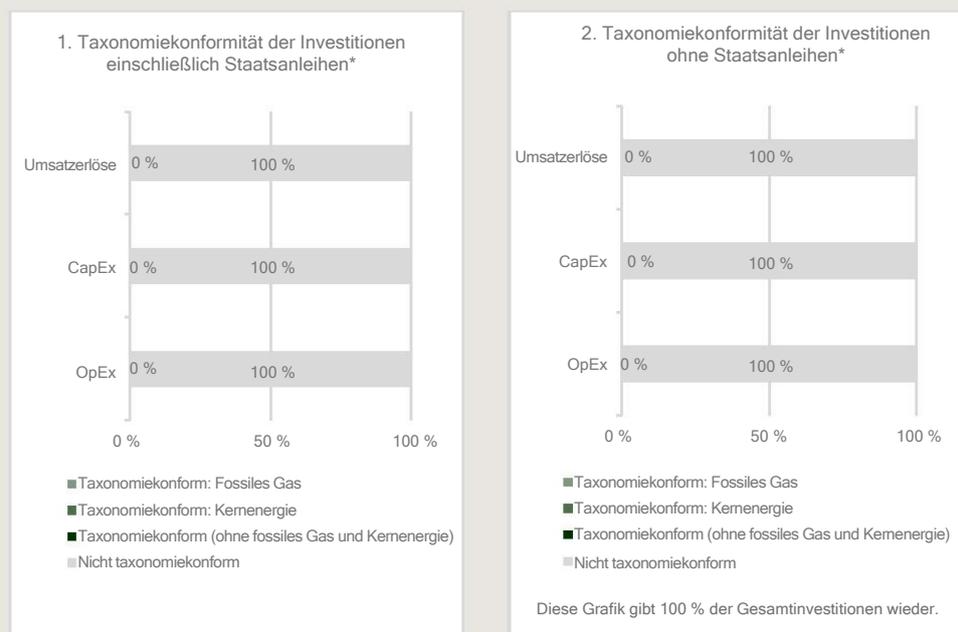
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 40 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 46 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

- (a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie;
- (b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;
- (c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert;
- (d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300SQTZQN0X1QH054

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 92 % an nachhaltigen Investitionen

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 93 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating und 7 % der Anlagen des Produkts ein B-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen. 4,18 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen. 4,18 % der Vermögenswerte, die anhand der JSS Sustainability Matrix überprüft wurden, wurden aus dem Universum nachhaltiger Investitionen ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x		x	Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur
2	CO2-Fußabdruck	x	x		x	
3	THG-Emissionsintensität	x	x		x	
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x		x	
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x		x	

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x		x	<p>Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3).</p> <p>In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.</p> <p>Im Mai 2020 startete JSS ein Klimaversprechen mit dem Ziel, bis 2035 einen CO2-neutralen Ausgang zu erreichen. Kontrollen der THG-Emissionen werden anhand des CO2-Fußabdrucks durchgeführt und gelten für eine Untergruppe von Fonds. Das Klimaversprechen wird für die nachhaltigen Anlagestrategien umgesetzt und durch den rückwärts gerichteten Dekarbonisierungspfad verfolgt, um Übergangsrisiken zu mindern. Die Methodik definiert die Zielsetzung als eine Reduzierung des THG-Emissionen-Fußabdrucks der Benchmark um 30 %, der in den folgenden Jahren um 7 % reduziert wird. Ab 2030 reduziert sich das Ziel linear bis zum Erreichen von Netto-Null in 2035. Die THG-Emissionen des Portfolios auf Basis der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO2e pro USD Mio. EVIC ausgedrückt.</p>
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			<p>In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.</p>

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Nebenprodukte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle			x		JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen			x		JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen			x		Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
MICROSOFT CORP.	USA	Sonstige Softwareveröffentlichung	7,74 %
SYNOPSIS INC.	USA	Verlagsaktivitäten	7,12 %
ANALOG DEVICES INC	USA	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	5,64 %
SERVICENOW INC	USA	Computerprogrammierungstätigkeiten	5,40 %
ALPHABET INC -A-	USA	Webportale	4,42 %
ONTO INNOVATION	USA	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	4,26 %
APPLIED MATERIALS INC	USA	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	4,16 %
NVIDIA CORP.	USA	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	3,92 %
INTEL CORP.	USA	Herstellung von elektronischen Komponenten	3,41 %
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	USA	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	3,11 %
METSO OUTOTEC RG REGISTERED SHS	FI	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	3,11 %
STMICROELECTRONICS NV	NL	Herstellung von elektronischen Komponenten	3,11 %
ROHM CO.LTD	JP	Herstellung von elektronischen Komponenten	2,94 %
AMAZON COM INC	USA	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	2,92 %
TOKYO ELECTRON CO LTD	JP	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	2,81 %

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

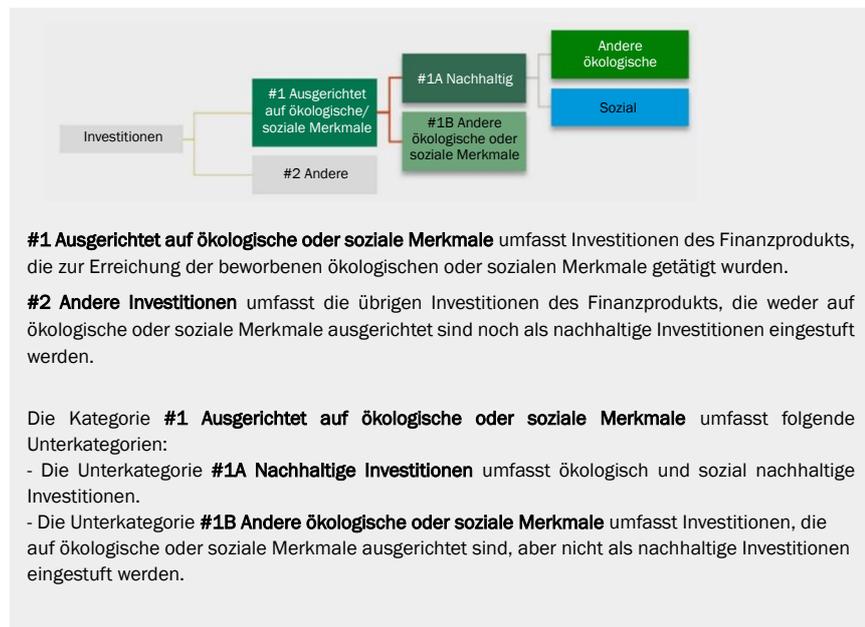
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 92 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 38 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 54 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 100 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 92 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 38 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 54 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 8 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 0 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	0,89 %
	Sonstige Kreditinstitute	0,02 %
	Immobilienaktivitäten	1,05 %
Information und Kommunikation	Computerprogrammierungstätigkeiten	5,09 %
	Informationsdienste	2,08 %
	Sonstiges Verlagswesen	2,56 %
	Sonstige Softwareveröffentlichung	11,09 %
	Verlagsaktivitäten	16,00 %
	Veröffentlichung von Computerspielen	0,38 %
	Fernsehsendungen und Rundfunk	1,81 %
	Webportale	4,22 %
Herstellung	Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	3,46 %
	Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	21,43 %
	Herstellung von elektronischen Komponenten	15,47 %
	Herstellung von Hebezeugen und Fördermitteln	0,93 %
	Herstellung von Maschinen und Anlagen a. n. g.	5,97 %
	Herstellung von optischen und fotografischen Instrumenten und Geräten	1,38 %
Bergbau und Steinbruch	Abbau von Metallerzen	0,75 %
Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	1,34 %
Groß- und Einzelhandel, Reparatur von Kraftfahrzeugen und Motorrädern	Einzelhandelsverkauf über Versandhäuser oder über das Internet	3,83 %

Dieses Finanzprodukt war nicht in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen engagiert.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

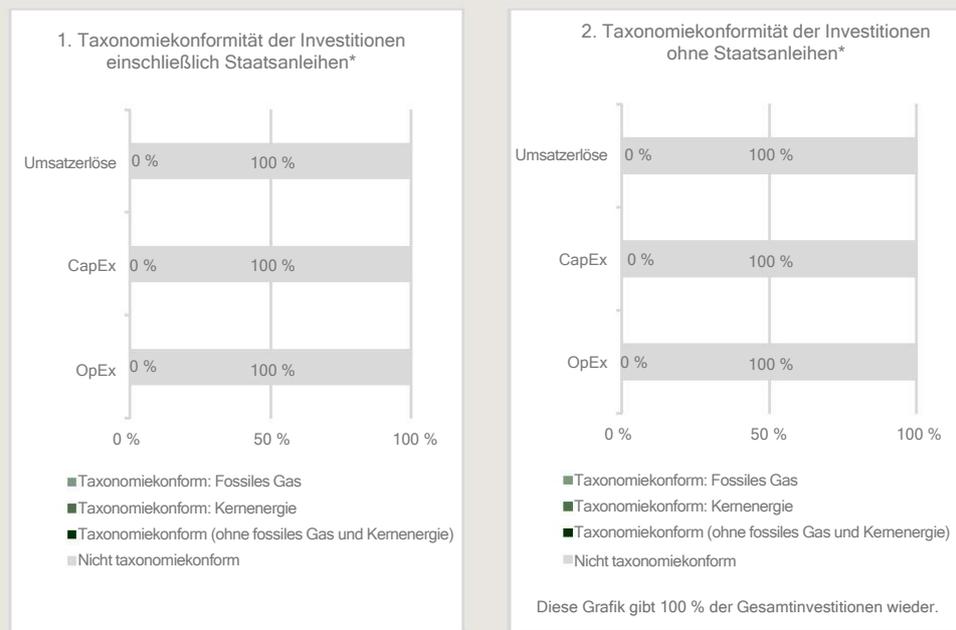
Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

- Ja
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 38 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 54 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts verfolgte einen strengen Prozess, bei dem ESG-Aspekte durchweg integriert wurden. Der Anlageverwalter berücksichtigte die folgenden Kriterien in seiner Strategie:

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

(a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie. Darüber hinaus schließt das Finanzprodukt Emittenten mit unkonventionellen Öl- und Gasaktivitäten (Teersand und Fracking) aus, wenn die mit diesen Aktivitäten erwirtschafteten Erträge mehr als 5 % betragen.

(b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen. Emittenten mit einem Rating von A- oder B werden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt ist. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickeln und nicht unter die definierten Schwellenwerte fallen;

(c) Um ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erzielen, investierte dieses Produkt nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating;

(d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der nachhaltigen Entwicklungsziele (SDGs) der UN übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Darüber hinaus engagierte sich der Anlageverwalter mit ausgewählten Beteiligungsunternehmen, um einen Verhaltenswechsel hin zu nachhaltigen Praktiken und/oder zur Bewerbung ökologischer oder sozialer Merkmale zu fördern.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:

Unternehmenskennung (LEI-Code):

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency

5493009TYM1SZ3ZRZ921

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 45 % an nachhaltigen Investitionen.

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt berücksichtigt Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekte („ESG“) entlang des Investmentprozesses mit dem Ziel, auf Basis der proprietären J. Safra Sarasin („JSS“) Sustainability Matrix für das gesamte Portfolio ein überdurchschnittliches ESG-Profil zu erreichen.

Das JSS ESG-Rating bewertet Emittenten im Vergleich zu ihren Mitbewerbern und reicht von Emittenten mit A-Rating, die als erstklassig angesehen werden, bis zu Emittenten mit D-Rating, die sich an umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligen können. Im Rahmen des nachhaltigen Anlageprozesses werden Emittenten, die grundsätzlich nicht an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und daher wahrscheinlich erheblichen Schaden verursachen werden, mit C (schlechteste Performance im Vergleich zu ihren Pendanten in der Branche) oder D (aufgrund umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse der Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, eine ESG-Perspektive auf die Länderratings anzuwenden. JSS misst die nachhaltige wirtschaftliche Leistung eines Landes anhand (i) der Verfügbarkeit natürlicher Ressourcen und (ii) der Effizienz ihrer Nutzung. Nachhaltigkeitsratings für Länder dienen als ergänzendes Instrument in der Finanzanalyse ihrer Kreditratings.

Die folgenden Ausschlusskriterien (mit Umsatzgrenzen) wurden während des Berichtszeitraums für das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Arten von Waffen, die aufgrund ihrer langfristigen humanitären Wirkung und/oder der großen Anzahl von zivilen Opfern, die sie fordern, als umstritten eingestuft werden. Dazu gehören biologische, chemische und nukleare Waffen, Streumunition und Antipersonenminen (Umsatzschwelle: 0 %);
- Verteidigung und Bewaffnung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und kritische Komponenten) und Waffenunterstützungssysteme und -Dienste (z. B. Waffenkontrollsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kernenergie: Unternehmen, die Kernkraftwerke besitzen oder betreiben (Versorger) und Unternehmen, die Kernkraftwerke mit wichtigen nuklearspezifischen Produkten oder Dienstleistungen beliefern (Lieferanten) (Umsatzschwelle: 5 %);
- Kohle: Unternehmen, die gleichzeitig eine erhebliche Beteiligung am Kohlegeschäft und keine solide Übergangsstrategie zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft haben (Umsatzschwelle: 5 % für Kohleförderung und 20 % für Stromerzeugung);
- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen für die landwirtschaftliche Nutzung genetisch verändern (Umsatzschwelle: 0 %);
- Genetisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0 %);
- Tabak: Tabakproduzenten (Umsatzschwelle: 5 %);
- Erwachsenenunterhaltung: Hersteller von Erwachsenenunterhaltungsmaterialien (Umsatzschwelle: 5 %);
- Verletzung der Menschenrechte und anderer Grundsätze des Global Compact: Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen oder anderen Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze beteiligt sind, in Übereinstimmung mit etablierten internationalen Standards (Umsatzschwelle: 0 %).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Datum dar. Nachhaltige Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem gesellschaftlichen Ziel beitragen, tragen in gleichem Maße zu beiden bei.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**
- Anteil der mit A- und B bewerteten Vermögenswerte: Die ESG-Screening-Analyse eines Unternehmens setzt sich aus zwei Elementen zusammen: Einem Unternehmensrating und einem Branchenrating. Jedes Rating berücksichtigt ESG-Schlüsselthemen, Umsätze im Zusammenhang mit den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, SDG), CO₂-Kennzahlen und andere relevante nachhaltigkeitsbezogene Daten. Das Unternehmens- und das Branchenrating werden dann kombiniert und in der proprietären JSS Sustainability Matrix angezeigt, die zur Bestimmung des JSS ESG-Ratings verwendet wird. Am Ende des Berichtszeitraums hatten 47 % der Anlagen des Produkts ein A-Rating und 45 % der Anlagen des Produkts ein B-Rating. Barmittel wurden bei der Berechnung des Anteils von Anlagen mit A- oder B-Rating nicht berücksichtigt.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Nicht zutreffend

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der Kohlenstoffemissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Outperformance von mindestens 75 % der Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche Umwelt- und/oder soziale Indikatoren oder durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren der folgenden SDGs übereinstimmen: Keine Armut, kein Hunger, gute Gesundheit und Wohlbefinden; hochwertige Bildung; Gleichstellung der Geschlechter; sauberes Wasser und Hygiene; erschwingliche und saubere Energie; ordentliche Arbeit und Wirtschaftswachstum; Industrie, Innovation und Infrastruktur; weniger Ungleichheiten; verantwortungsvoller Konsum und Produktion; Klimaschutz, Leben unter Wasser, Leben auf Land; Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der DNSH-Test („Do No Significant Harm“ - Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen) schließt Emittenten aus, die grundlegend an Nachhaltigkeitspraktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellen für Indikatoren für negative Auswirkungen nicht erreichen. Darüber hinaus werden Emittenten mit einem U-, S- oder G-Score von weniger als -2 Standardabweichungen von der Subbranche ausgeschlossen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen, die durch Indikatoren für negative Auswirkungen angezeigt werden, im Rahmen des Anlageprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Anlagen erreicht, die den ökologischen oder sozialen Mindestschutz nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Das Engagement dient der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, das ESG-Screening und die Definition des Anlageuniversums basieren auf der JSS-Politik und -Strategie für nachhaltige Investitionen, die die Prinzipien verschiedener internationaler Konventionen und Normen integrieren, darunter:

die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen,

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,
der Globale Pakt der Vereinten Nationen (UNGC),
die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,
die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,
die kinderrechtlichen Grundsätze für Unternehmen,
die ILO-Konventionen zu Arbeitsstandards,
die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,
das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,
das Übereinkommen über Streumunition.

Das ESG-Screening hilft dabei, börsennotierte Unternehmen zu identifizieren, die mutmaßlich an Verstößen gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung beteiligt sind, wie sie in den OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte dargelegt sind. Solche Unternehmen werden als nicht mit den oben genannten Grundsätzen kompatibel angesehen und aus dem nachhaltigen Anlageuniversum von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die im Anlageprozess berücksichtigt wurden, und die zu ihrer Behebung ergriffenen Maßnahmen sind nachfolgend beschrieben:

Nr.	PAI-Indikator	Ausschlüsse	Sustainability Matrix	Mitwirkung und/oder Abstimmung	Klimaschutz	Beschreibung
Unternehmen						
1	THG-Emissionen	x	x			Die schädlichsten Aktivitäten im Bereich fossiler Brennstoffe sind ausgeschlossen. Ab dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Einnahmen aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 20\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 20\%$ aus einer Kombination aus Kraftwerkskohle und Stromerzeugung erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen. In Sektoren, in denen Kohlenstoffemissionen als wesentlicher ESG-Faktor angesehen werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens in Bezug auf Kohlenstoffemissionen. Dazu gehört die Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Reduzierung der Emissionsintensität der Kerngeschäfte, zur Reduzierung des zukünftigen Energieverbrauchs oder der Treibhausgas(THG)-Emissionen (1, 2, 3). In Sektoren, in denen Gelegenheiten bei erneuerbaren Energien als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei erneuerbaren Energien. Dazu gehört auch eine Bewertung der Kapazitäten eines Unternehmens für erneuerbare Energien.
2	CO2-Fußabdruck	x	x			
3	THG-Emissionsintensität	x	x			
4	Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind	x	x			
5	Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen	x	x			
6	Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren	x	x			
7	Aktivitäten, die die Biodiversität beeinträchtigen.		x			In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung als wesentlicher ESG-Faktor betrachtet werden, erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens bei Biodiversität und Landnutzung. Dazu gehört auch eine Bewertung der Auswirkungen der Aktivitäten eines Unternehmens auf die Biodiversität.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

8	Emissionen in Wasser		x			In Sektoren mit erheblichen Wasseremissionen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Unternehmens beim Wassermanagement. Das Wassermanagement umfasst eine Bewertung von wassereffizienten Produktionsprozessen, Wasserintensitätstrends und messbaren, zeitgebundenen Zielen bei der Reduzierung des Wasserverbrauchs.
9	Gefährlicher Abfall		x			In Sektoren mit erheblichen toxischen Emissionen und Abfällen erfasst die JSS Sustainability Matrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf toxische Emissionen und Abfallmanagement. Das Management toxischer Emissionen umfasst eine Beurteilung der Bemühungen, die Menge der toxischen und karzinogenen Nebenprodukte aus dem Betrieb zu kontrollieren und zu reduzieren, der Trends der toxischen Freisetzung und der messbaren, zeitgebundenen Ziele bei der Reduzierung toxischer Emissionen.
10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze	x				JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.
11	Fehlende Prozesse zur Überwachung des UNGC.					Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Teil der JSS Sustainability Matrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Anlageprozess integrieren, sobald die Offenlegungsraten ausreichend sind. In der Zwischenzeit ist eine Überwachung von ESG-Vorfällen vorhanden, die unter anderem kontinuierlich auf Compliance-Verstöße des UNGC überprüft.
12	Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle					Derzeit für dieses Produkt nicht bewertet. JSS befasst sich mit Vergütungsfragen bei Unternehmen, in die investiert wird, durch die Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten im Zusammenhang mit der Mitwirkung bei Unternehmen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

13	Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen					Derzeit für dieses Produkt nicht bewertet. JSS überprüft die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen durch Ausübung seiner Eigentumsrechte, einschließlich der Ausübung von Stimmrechtsvertreterstimmungen und Aktivitäten zur Mitwirkung im Unternehmen.
14	Engagement in umstrittenen Waffen	x				JSS erfüllt seine Verantwortung aktiv mit einem gruppenweiten Ausschluss in Bezug auf umstrittene Waffen. JSS investiert seine eigenen Mittel nicht in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich umstrittener Waffen tätig sind. Darüber hinaus erbringt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für diese Gesellschaften oder Dienstleistungen in Bezug auf Kapitalmärkte oder Fusionen und Übernahmen.
Staatsanleihen						
15	THG-Emissionsintensität		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die externen Umweltkosten eines Landes. Die THG-Emissionen pro Kopf sind eine in diesem Zusammenhang bewertete Kennzahl.
16	Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen		x			Für das Sovereign JSS ESG-Rating erfasst die JSS Sustainability Matrix die Performance eines Landes im Bereich der Grundrechte.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden:
01.07.2022 – 30.06.2023

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Instruments	Land	Sektor	Gewichtung
SOUTH AFR 8,75 % 14-31.01.44	ZA	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	5,49 %
FAR EAST HO 4,70 % 21-09.02.24	HK	Finanzierungsleasing	4,21 %
MALAYSIA 2,632 % 20-15.04.31	MY	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	4,15 %
SOUTH AFR 8,5 % 13-31.01.37	ZA	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	4,12 %
EBRD 4,60 % 20-09.12.25	GB	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,85 %
INDONESIA 8,375 % 18-15.04.39	ID	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,84 %
BRAZIL 10 % 20-01.01.31	BR	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,69 %
SOUTH AFRICA 6,5 % 10-28.02.41	ZA	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,58 %
CHILE 4,7 % 18-01.09.30	CL	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,50 %
MEXICO CETE 8 % 22-31.07.53	MX	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,50 %
COLOMBIA 9,85 % 07-27 /INT.USD	CO	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,24 %
SIMPAR FIN 10,75 % 12.2.28 REGS	LU	Beteiligungsgesellschaften	3,16 %
CZECH REP 2 % 17-13.10.33	CZ	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,08 %
MALAYSIA 4,369 % 18-31.10.28	MY	Vermittlung von Wertpapieren und Warentermingeschäften	2,71 %
CHINA DV BK 4,3 % 12-02.08.32	KN	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,68 %



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 45 %. Bei den Investitionen des Finanzprodukts handelte es sich zu 22 % um ökologisch nachhaltige Investitionen und zu 23 % um sozial nachhaltige. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts, die die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreichten, lag bei 85 %. Die Kategorie „#1A Nachhaltig“ bestand zu 45 % aus nachhaltigen Investitionen mit ökologischen und sozialen Zielen. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Andere ökologische“ betrug 22 %. Der Anteil der Investitionen des Finanzprodukts in der Unterkategorie „Sozial“ betrug 23 %. Auf die Kategorie „#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale“ entfielen 40 % der Investitionen des Produkts. Der Anteil der unter „#2 Andere“ enthaltenen Investitionen betrug 15 %. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Investitionen erfolgten in folgenden Sektoren:

Bezeichnung des Sektors	Bezeichnung des Teilsektors	Gewichtung in %
Aktivitäten exterritorialer Organisationen und Körperschaften	Aktivitäten exterritorialer Organisationen und Körperschaften	7,09 %
Energieversorgung	Energieversorgung	1,96 %
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	Beteiligungsgesellschaften	4,86 %
	Finanzierungsleasing	3,91 %
	Sonstige Kreditinstitute	2,16 %
	Sonstige Kreditinstitute	5,52 %
	Vermittlung von Wertpapieren und Warentermingeschäften	2,52 %
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	Allgemeine öffentliche Verwaltung	1,94 %
	Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; gesetzliche Sozialversicherung	63,81 %

Dieses Finanzprodukt war nicht in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen engagiert.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Prozentsatz der Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 0 %.

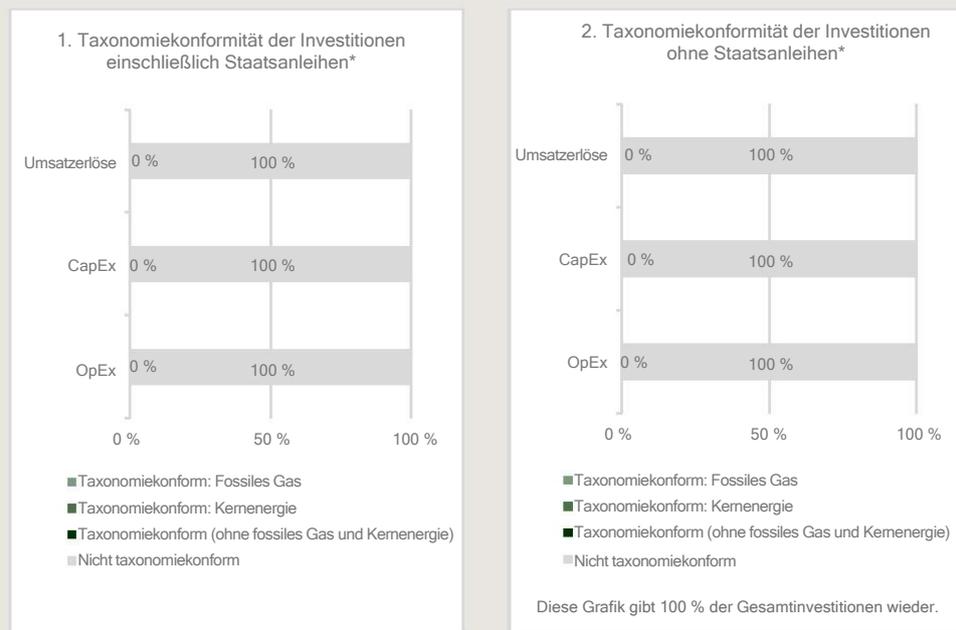
Solange die Datenlage zur Beurteilung der Anpassung der EU-Taxonomie nicht breiter und zuverlässiger ist, kann der Anlageverwalter nicht genau berechnen, inwieweit die nachhaltigen Anlagen mit einem Umweltziel im Einklang mit der EU-Taxonomie sind. Da sich die Datenverfügbarkeit verbessert, wird erwartet, dass diese Berechnung genauer wird, sodass den Anlegern in den kommenden Jahren aussagekräftigere Informationen zur Verfügung gestellt werden können. Solche Daten werden daher in eine künftige Version dieses Dokuments integriert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie¹ investiert?

Ja
 In fossiles Gas
 In Kernenergie

Nein

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten betrug 0 %. Der Anteil der Investitionen in ermöglichende Tätigkeiten betrug 0 %.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**
Nicht zutreffend

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 22 %. Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein, der Anlageverwalter ist jedoch derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Investitionen des Finanzprodukts gemäß der EU-Taxonomie anzugeben. Die Position wird jedoch weiterhin überprüft, da die zugrunde liegenden Regeln festgelegt werden und die Verfügbarkeit zuverlässiger Daten mit der Zeit steigt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag bei 22 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die Kassenbestände und Derivate des Produkts, deren Hauptzweck die Absicherung von Risiken war, wurden unter „#2 Andere Investitionen“ ausgewiesen. Derzeit ist keine Methodik zur Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen vereinbart. Ebenfalls berücksichtigt wurden Investitionen, die aufgrund unzureichender Daten nicht als an den ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet bewertet werden können. Als Mindestschutz entsprechen diese Investitionen der JSS-Ausschlussrichtlinie und überschreiten nicht die definierten Umsatzschwellen.

Offenlegungsverordnung (ungeprüft) (Fortsetzung)



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Anlageverwalter hat die folgenden verbindlichen Kriterien in seiner Strategie angewandt:

(a) Vermeidung kontroverser Engagements gemäß der JSS-Ausschlussrichtlinie;

(b) Abmilderung von ESG-Risiken und Nutzung von ESG-Chancen: Emittenten mit einem Rating von A- oder B wurden ausgeschlossen, wenn ihr U-, S- oder G-Score weniger als -2 Standardabweichungen von der Teilbranche entfernt war. Dadurch wurde sichergestellt, dass sich die Emittenten über alle wesentlichen ESG-Faktoren hinweg gut entwickelten und nicht unter die definierten Schwellenwerte fielen;

(c) Erzielung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles: Dieses Produkt hat nicht in Emittenten mit C- oder D-Rating investiert;

(d) Absichtliche Ausrichtung auf messbare positive Ergebnisse durch Anlagen in Emittenten, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, bestimmt durch den Anteil der Umsätze der Emittenten, der mit einer der UN-SDGs übereinstimmt, oder wenn der Emittent operative Exzellenz erreicht, die sich durch eine Outperformance von mindestens 75 % seiner Mitbewerber im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren ergibt. Während des Berichtszeitraums befanden sich die Unternehmen des Produkts, in die investiert wird, nicht im Bereich der Mitwirkungsaktivitäten des Anlageverwalters.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Nicht zutreffend
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Nicht zutreffend