

JPMorgan Funds -

Green Social Sustainable Bond Fund

Anteilklasse: JPM Green Social Sustainable Bond S2 (acc) - EUR (hedged)

Fondsüberblick

| | | | |
|----------------------|-----------------------------|--------------------------------|------------------------------------|
| WKN A3DXWT | ISIN LU2545254133 | Bloomberg JPGS2AH LX | Reuters LU2545254133.LUF |
|----------------------|-----------------------------|--------------------------------|------------------------------------|

Anlageziel: Erzielung eines langfristigen Ertrags, welcher den Vergleichsindex übertrifft. Dies erfolgt durch die vorwiegende Anlage in Schultiteln, deren Erlöse in Projekte und Maßnahmen fließen, die zu einer nachhaltigen und integrativen Wirtschaft beitragen.

Anlageansatz

- Der Teilfonds wendet einen global integrierten, Research-basierten Anlageprozess an, der sich auf die Analyse fundamentaler, quantitativer und technischer Faktoren über verschiedene Länder, Sektoren und Emittenten hinweg konzentriert.
- Er verfolgt ein nachhaltiges Anlageziel, das durch ein solides Risikomanagement und einen Governance-Rahmen untermauert wird.
- Der Teilfonds nutzt einen unternehmenseigenen Rahmen, der an anerkannten Branchenstandards ausgerichtet ist, um nachhaltige Emissionen zu ermitteln, die zu einer nachhaltigen und integrativen Wirtschaft beitragen.

| | | |
|--|--|---|
| Portfoliomanager Ed Fitzpatrick Stephanie Dontas Usman Naeem | Auflegungsdatum des Fonds 9 Nov. 2022 | Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge Ausgabeaufschlag (max.) 0,00% |
| Referenzwährung des Fonds USD | NAV EUR 108,94 | Rücknahmeabschlag (max.) 0,00% |
| Anteilklassenwährung EUR | Auflegungsdatum der Anteilklasse 26 Jun. 2024 | Laufende Kosten 0,29% |
| Fondsvolumen USD 59,9Mio. | Domizil Luxemburg | |

ESG-Informationen

ESG-Ansatz – Thematisch

Anlagen in Themen oder Vermögenswerten, die in einem speziellen Zusammenhang mit Nachhaltigkeit stehen.

Klassifizierung gemäß SFDR: Artikel 9

„Artikel 9“-Fonds haben ein nachhaltiges Anlageziel.

Fonds-Ratings per 28 Februar 2026

Morningstar-Kategorie™ Anleihen Global EUR-hedged

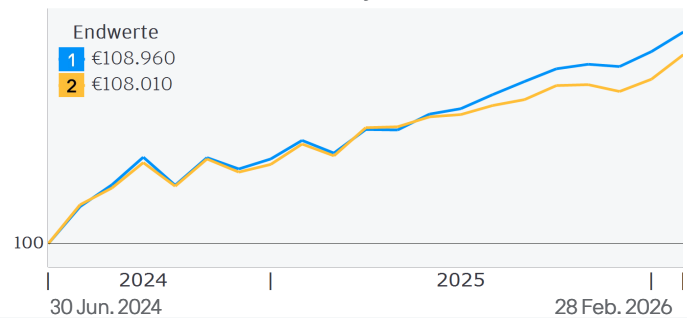
Wertentwicklung

1 Anteilklasse: JPM Green Social Sustainable Bond S2 (acc) - EUR (hedged)

2 Referenzindex: Bloomberg Global Aggregate Green Social Sustainability Bond 1-10 Year Index Hedged to EUR

3 Anteilklasse: Wertentw. Abzgl. Ausgabeaufschlag

ZUWACHS VON 100.000 EUR Kalenderjahre



Fortlaufende 12-Monats-Wertentwicklung (%)

Per Ende Februar 2026

| | 2016/2017 | 2017/2018 | 2018/2019 | 2019/2020 | 2020/2021 |
|---|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 1 | - | - | - | - | - |
| 2 | - | - | - | - | - |
| | 2021/2022 | 2022/2023 | 2023/2024 | 2024/2025 | 2025/2026 |
| 1 | - | - | - | - | 4,39 |
| 2 | - | - | - | - | 3,63 |
| 3 | - | - | - | - | 4,39 |

ERTRAG (%)

| | KUMULATIV | | | | Jährliche Wertentwicklung | | |
|---|-----------|----------|--------|------|---------------------------|---------|-----------|
| | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | YTD | 3 Jahre | 5 Jahre | Auflegung |
| 1 | 0,77 | 1,27 | 4,39 | 1,35 | - | - | 5,24 |
| 2 | 0,97 | 1,20 | 3,63 | 1,46 | - | - | 4,66 |

OFFENLEGUNG DER PERFORMANCE

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

ESG

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

Positionen

| TOP 10 | Kupon | Fälligk.- Datum | % des Vermögens |
|--|-------|--------------------|-----------------------|
| FHLM (USA) | 4,967 | 25.10.2054 | 4,3 |
| Government of Germany (Deutschland) | - | 15.08.2030 | 3,3 |
| FNMA (USA) | 4,900 | 01.12.2032 | 3,3 |
| FNMA (USA) | 3,140 | 01.07.2032 | 2,7 |
| FHLM (USA) | 5,000 | 01.05.2054 | 2,3 |
| CADES (Frankreich) | 1,500 | 25.05.2032 | 2,0 |
| National Grid (Großbritannien) | 0,250 | 01.09.2028 | 1,7 |
| UNEDIC (Frankreich) | 0,250 | 25.11.2029 | 1,6 |
| Caixabank (Spanien) | 0,500 | 09.02.2029 | 1,5 |
| Japan Finance Organization For Municipalities (Japan) | 2,875 | 23.01.2029 | 1,5 |

Aufteilung nach Rating (%)

| | |
|---------------------|--|
| AAA: 13,32% | Unternehmensanleihen: 45,16% |
| AA: 21,22% | Durchschnittliche Duration: 4,66 Jahre |
| A: 24,81% | Rendite zur Endfälligkeit (USD): 3,82% |
| BBB: 27,02% | Durchschnittliche Restlaufzeit: 5,42 Jahre |
| < BBB: 13,78% | |
| Kein Rating: -0,15% | |

Die angegebene Rendite bis zur Fälligkeit ist zum 28.02.26 berechnet und berücksichtigt keine Kosten, Änderungen am Portfolio, Marktschwankungen und potenziellen Zahlungsausfälle. Die Rendite bis zur Fälligkeit hat lediglich indikativen Charakter und kann sich ändern.

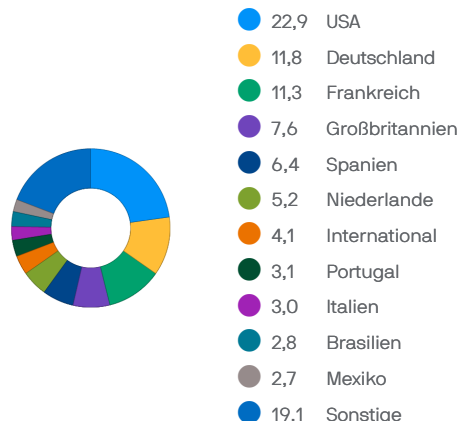
Aufgrund von Rundungen ist es möglich, dass die Addition der Zahlen nicht 100 ergibt.

VALUE-AT-RISK (VAR)

per 27 Februar 2026

| | Fonds | Referenzindex |
|-----|-------|---------------|
| VaR | 4,17% | 4,15% |

REGIONEN (%)



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

SEKTOREN (%)

| SEKTOREN (%) | Im Vergleich zur Benchmark |
|---|---|
| Investment-Grade- Unternehmensanleihen | 36,4 +6,4 |
| quasi-staatliche Papiere | 21,6 -23,7 |
| Agency-Hypothekenanleihen | 12,6 +12,1 |
| EMD in Hartwährung | 10,2 +2,7 |
| High-Yield- Unternehmensanleihen | 8,7 +8,5 |
| Staatsanleihen | 4,3 -5,3 |
| EMD in Lokalwährung | 3,3 +0,9 |
| Covered Bond | 0,0 -4,4 |
| Barvermögen | 2,9 +2,9 |

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

Hauptrisiken

Der Teilfonds unterliegt **Anlagerisiken** und **sonstigen verbundenen Risiken** aus den Techniken und Wertpapieren, die er zur Erreichung seines Anlageziels einsetzt.

Die nachstehende Tabelle wird erläutert, wie diese Risiken miteinander im Zusammenhang stehen. Sie erklärt auch die **Ergebnisse für den Anteilseigner**, die sich auf eine Anlage in diesem Teilfonds auswirken könnten.

Anleger sollten im [Verkaufsprospekt](#) auch die Beschreibung der Risiken mit einer vollständigen Beschreibung jedes einzelnen Risikos lesen.

Anlagerisiken Risiken in Verbindung mit den Techniken und Strategien des Teilfonds

| Techniken | Wertpapiere |
|-------------|---|
| Absicherung | China - Staatsanleihen |
| Thematisch | Schuldtitle - Schuldtitle ohne Rating |
| | - Investment-Grade-Anleihen Schwellenländer |
| | - Anleihen unterhalb MBS/ABS von Investment Grade |

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

| | | |
|------------|---------|--------|
| Kredit | Markt | Zinsen |
| Liquidität | Währung | |

Ergebnisse für den Anteilinhaber Potenzielle Auswirkungen der oben genannten Risiken

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

Allgemeine Offenlegungen

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

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

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

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

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

Weitere Informationen zum Zielmarkt des Teilfonds finden Sie im Verkaufsprospekt.

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

Die laufenden Kosten sind die Kosten, die im EU-Basisinformationsblatt für PRIIPs verwendet werden. Diese Kosten entsprechen den Gesamtkosten für die Verwaltung und den Betrieb des Fonds, einschließlich der Verwaltungsgebühren, Verwaltungskosten und sonstiger Aufwendungen (ohne Transaktionskosten). Die Aufschlüsselung der Kosten entspricht den im Fondsprospekt angegebenen Höchstbeträgen. Ausführlichere Informationen entnehmen Sie bitte dem Fondsprospekt und dem PRIIPs-Basisinformationsblatt, die auf unserer Website verfügbar sind.

Informationen zur Wertentwicklung

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

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

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

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

INFORMATIONEN ZUR DARSTELLUNG DER WERTENWICKLUNG

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

Informationen zu den Beständen

Der Fälligkeitstermin bezieht sich auf den Fälligkeits-/Zinsanpassungstermin des Wertpapiers. Für Wertpapiere, deren Referenz-Kupon mindestens alle 397 Tage angepasst wird, ist das Datum der nächsten Kupon-Anpassung angegeben.

Informationsquellen

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

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

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

Regionaler Ansprechpartner

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

Herausgeber

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

Definitionen

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