

SSGA Luxembourg SICAV - State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund I EUR Inc

Categoria Morningstar™

Aziende Global Equity Med

Benchmark Morningstar

Global Target Market

Benchmark Dichiarato

MSCI World NR USD

Morningstar Rating™

★★

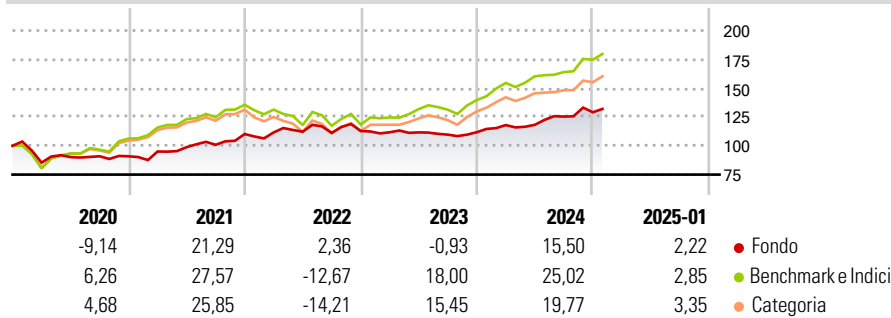
Exposure NR USD

Usato nel Report

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

L'obiettivo del Fondo è quello di fornire rendimenti competitivi in relazione all'Indice MSCI World (Net) (l' "Indice") nel lungo termine mantenendo una volatilità relativamente bassa.

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	-2,56	3Y Sharpe Ratio	0,52
3Y Beta	0,61	3Y Std Dev	9,05
3Y R-Squared	69,09	3Y Risk	Basso
3Y Info Ratio	-0,46	5Y Risk	Basso
3Y Tracking Error	8,98	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Global Target Market Exposure NR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,06	9,06	7,74	2025	-	-	-	-
6-Mesi	7,76	16,12	12,44	2025	-	-	-	-
1-Anno	15,16	23,21	19,93	2024	5,54	0,21	6,03	3,00
3-Anni Ann.ti	6,88	11,78	9,50	2023	-0,96	-0,10	-1,74	1,90
5-Anni Ann.ti	4,94	11,89	9,85	2022	1,26	0,53	-0,97	1,53
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	4,63	3,93	2,09	9,26

Rendimenti aggiornati al 31/01/2025

Portafoglio 31/12/2024



Asset Allocation %	Netta
Azioni	99,59
Obbligazioni	0,00
Liquidità	0,41
Altro	0,00

Style Box

Azionaria

Capitalizz.	Value	Blend	Growth
Large	■		
Mid			
Small			

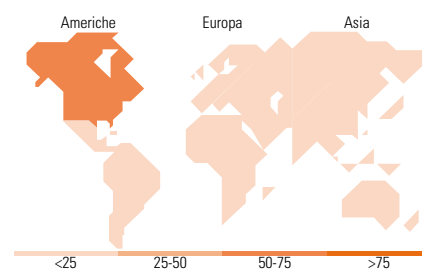
Style

Mkt Cap %

Fondo	Fondo
Giant	15,25
Large	39,92
Medium	44,83
Small	0,00
Micro	0,00

Capitalizzazione media di mercato

Fondo	Fondo
Ave Mkt Cap USD	47.839,98



Titoli principali

Nome	Settore	%
McKesson Corp	■	1,22
Entergy Corp	■	1,21
Dollarama Inc	■	1,18
Cheniere Energy Inc	■	1,17
AbbVie Inc	■	1,16
Cardinal Health Inc	■	1,15
Arthur J. Gallagher & Co	■	1,15
Cisco Systems Inc	■	1,14
Metro Inc	■	1,13
Singapore Exchange Ltd	■	1,12
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		11,63
Numero Complessivo di Titoli Azionari		181
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Distribuzione Settoriale %

Fondo	Fondo
Ciclico	17,56
Materie Prime	-
Beni di Consumo Ciclici	3,92
Finanza	12,15
Immobiliare	1,49
Sensibile	27,06
Telecomunicazioni	12,36
Energia	6,15
Beni Industriali	5,13
Tecnologia	3,43
Difensivo	55,38
Beni Difensivi	24,48
Salute	23,30
Servizi di Pubblica Utilità	7,60

Ripartizione Geografica %

Fondo	Fondo
America	72,44
Stati Uniti	67,99
Canada	4,45
America Latina e Centrale	0,00
Europa	13,63
Regno Unito	1,40
Europa Occidentale - Euro	4,37
Europa Occidentale - Non Euro	6,20
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	1,66
Asia	13,93
Giappone	7,08
Australasia	0,15
Asia - Paesi Sviluppati	6,30
Asia - Emergente	0,40

Anagrafica

Società di Gestione	State Street Global Advisors Europe Limited	Patrimonio Classe (Mln)	24,34 EUR	Investimento Min. Ingresso	3.000.000 EUR
Telefono	+353 1 776 3000	(31/01/2025)		Investimento Min. Successivo	1.000 EUR
Web	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,45%
Data di Partenza	30/03/2016	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,45%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	24/03/2010	Inc/Acc	Inc		
NAV (31/01/2025)	EUR 15,84	ISIN	LU1338145581		
Patrimonio Netto (Mln)	222,45 USD				

(31/12/2024)