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

**Categoria Morningstar™**
Azionari Internazionali Large Cap Blend

**Benchmark Morningstar**
Morningstar Global Target Market Exposure NR USD
Usato nel Report

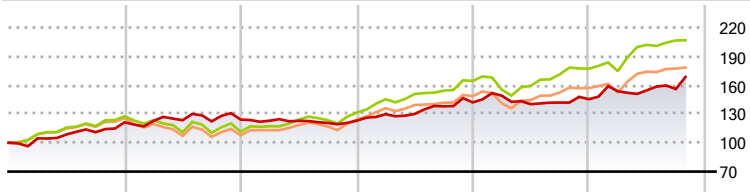
**Benchmark Dichiarato**
MSCI World NR USD

**Morningstar Rating™**
★★

## 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




| | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-10 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fondo | 21,29 | 2,36 | -0,93 | 15,50 | 2,35 | 15,92 |
| Benchmark e Indici | 27,57 | -12,67 | 18,00 | 25,02 | 7,77 | 16,69 |
| Categoria | 25,85 | -14,21 | 15,45 | 19,77 | 5,75 | 13,65 |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | 4,54 | 3Y Sharpe Ratio | 0,96 |
| 3Y Beta | 0,30 | 3Y Std Dev | 9,78 |
| 3Y R-Squared | 11,74 | 3Y Risk | Basso |
| 3Y Info Ratio | -0,61 | 5Y Risk | Basso |
| 3Y Tracking Error | 12,76 | 10Y Risk | Basso |

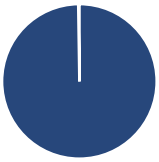
Basati su Morningstar Global Target Market Exposure NR USD (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | 7,86 | 0,69 | 0,86 |
| 6-Mesi | 14,20 | 7,09 | 8,27 |
| 1-Anno | 17,60 | 18,69 | 14,99 |
| 3-Anni Ann.ti | 12,67 | 18,83 | 15,42 |
| 5-Anni Ann.ti | 7,99 | 10,50 | 7,89 |
| 10-Anni Ann.ti | 7,75 | 12,17 | 9,84 |

Rendimenti aggiornati al 12/11/2026

| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | 5,71 | 0,60 | 0,88 | - |
| 2025 | 4,94 | -5,98 | 1,22 | 2,48 |
| 2024 | 5,54 | 0,21 | 6,03 | 3,00 |
| 2023 | -0,96 | -0,10 | -1,74 | 1,90 |
| 2022 | 1,26 | 0,53 | -0,97 | 1,53 |

## Portafoglio 31/10/2026



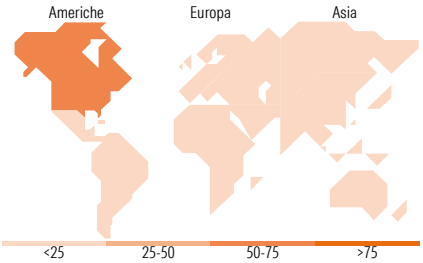
| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 100,24 |
| Obbligazioni | 0,00 |
| Liquidità | -0,24 |
| Altro | 0,00 |

**Style Box Azionaria**




| Mkt Cap % | Fondo |
|---|---|
| Giant | 14,71 |
| Large | 37,07 |
| Medium | 47,16 |
| Small | 1,06 |
| Micro | 0,00 |

| Capitalizzazione media di mercato | Fondo |
|---|---|
| Ave Mkt Cap USD | 72.393,03 |




### Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| Gilead Sciences Inc | | 1,34 |
| McKesson Corp | | 1,33 |
| Marathon Petroleum Corp | | 1,21 |
| The Travelers Companies Inc | | 1,20 |
| Johnson & Johnson | | 1,19 |
| Amgen Inc | | 1,15 |
| Walmart Inc | | 1,13 |
| Colgate-Palmolive Co | | 1,13 |
| Merck & Co Inc | | 1,12 |
| Williams Companies Inc | | 1,10 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 11,91 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 202 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 0 |

| Distribuzione Settoriale % | Fondo |
|---|---|
| **Ciclico** | **15,91** |
| Materie Prime | 0,01 |
| Beni di Consumo Ciclici | 2,90 |
| Finanza | 11,04 |
| Immobiliare | 1,96 |
| **Sensibile** | **34,33** |
| Telecomunicazioni | 12,16 |
| Energia | 7,78 |
| Beni Industriali | 4,66 |
| Tecnologia | 9,72 |
| **Difensivo** | **49,76** |
| Beni Difensivi | 21,09 |
| Salute | 19,13 |
| Servizi di Pubblica Utilità | 9,54 |

| Ripartizione Geografica % | Fondo |
|---|---|
| **America** | **74,03** |
| Stati Uniti | 68,73 |
| Canada | 5,15 |
| America Latina e Centrale | 0,16 |
| **Europa** | **14,22** |
| Regno Unito | 0,95 |
| Europa Occidentale - Euro | 3,78 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 6,44 |
| Europa dell'Est | 0,00 |
| Africa | 0,00 |
| Medio Oriente | 3,05 |
| **Asia** | **11,74** |
| Giappone | 5,26 |
| Australasia | 0,49 |
| Asia - Paesi Sviluppati | 5,32 |
| Asia - Emergente | 0,67 |

## Anagrafica

| | |
|---|---|
| Società di Gestione | State Street Global Advisors Europe Limited |
| Telefono | +353 1 776 3000 |
| Web | - |
| Data di Partenza | 30/03/2016 |
| Nome del Gestore | - |
| Data Inizio Gestione | 24/03/2010 |
| NAV (12/11/2026) | EUR 18,17 |
| Patrimonio Classe (Mln) (12/11/2026) | 29,11 EUR |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | EUR |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Inc |
| ISIN | LU1338145581 |
| Investimento Min. Ingresso | 3.000.000 EUR |
| Investimento Min. Successivo | 1.000 EUR |
| T.E.R. | 0,45% |
| Spese correnti | 0,45% |
| Commissione di incentivo | - |

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

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

Patrimonio Netto (Mln) 426,31 USD
(31-10-2026)

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.