

# SSGA Luxembourg SICAV - State Street Global Screened Managed Volatility Equity

**Categoria Morningstar™**  
Fund I EUR Inc  
Internazionale Large Cap Blend  
Exposure NR USD  
Usato nel Report

**Benchmark Morningstar**  
Morningstar Global Target Market  
Exposure NR USD

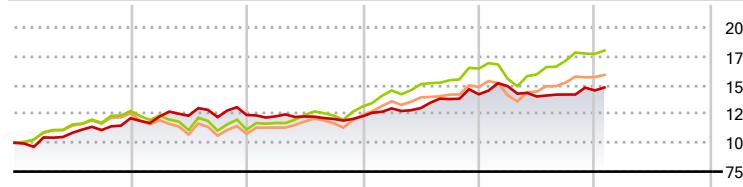
**Benchmark Dichiarato**  
MSCI World NR USD

**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	2026-01
21,29	2,36	-0,93	15,50	2,35	1,77
27,57	-12,67	18,00	25,02	7,77	1,64
					1,20
25,85	-14,21	15,45	19,77	5,75	
					1,26
					0,53
					-0,97
					1,53

## Misure di Rischio

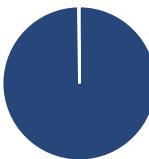
3Y Alpha	-2,28	3Y Sharpe Ratio	0,44
3Y Beta	0,53	3Y Std Dev	7,51
3Y R-Squared	33,54	3Y Risk	Basso
3Y Info Ratio	-1,01	5Y Risk	Basso
3Y Tracking Error	9,47	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,58	1,05	1,67	2026	-	-	-	-
6-Mesi	9,48	8,87	8,05	2025	4,94	-5,98	1,22	2,48
1-Anno	5,21	6,09	3,48	2024	5,54	0,21	6,03	3,00
3-Anni Ann.ti	7,60	14,90	11,85	2023	-0,96	-0,10	-1,74	1,90
5-Anni Ann.ti	9,02	11,08	8,85	2022	1,26	0,53	-0,97	1,53
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

## Portafoglio 31/12/2025



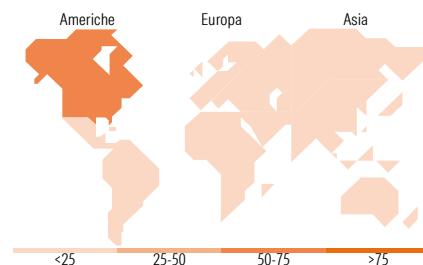
Asset Allocation %	Netta
• Azioni	100,22
• Obbligazioni	0,00
• Liquidità	-0,22
• Altro	0,00



Mkt Cap %	Fondo
Giant	14,52
Large	37,57
Medium	46,64
Small	1,28
Micro	0,00

Capitalizzazione media di mercato	Fondo
Ave Mkt Cap USD	58.264,4



Ripartizione Geografica %	Fondo
America	71,96
Stati Uniti	66,83
Canada	5,14
America Latina e Centrale	0,00
Europa	15,36
Regno Unito	1,33
Europa Occidentale - Euro	4,06
Europa Occidentale - Non Euro	6,86
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	3,11
Asia	12,68
Giappone	6,20
Australasia	0,28
Asia - Paesi Sviluppati	5,64
Asia - Emergenti	0,56

## Titoli principali

Nome	Settore	%
Cardinal Health Inc	+	1,21
McKesson Corp	+	1,18
Monster Beverage Corp	+	1,16
Novartis AG Registered Shares	+	1,14
Cencora Inc	+	1,11
Walmart Inc	+	1,10
Atmos Energy Corp	+	1,09
CCL Industries Inc...	+	1,06
Swisscom AG	+	1,06
PepsiCo Inc	+	1,05
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		11,16
Numeri Complessivo di Titoli Azionari		181
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Distribuzione Settoriale %	Fondo
● Ciclico	18,09
■ Materie Prime	0,04
▲ Beni di Consumo Ciclici	4,32
▼ Finanza	11,67
■ Immobiliare	2,06
■ Sensibile	26,64
■ Telecomunicazioni	12,52
■ Energia	5,44
■ Beni Industriali	5,11
■ Tecnologia	3,58
■ Difensivo	55,27
■ Beni Difensivi	23,39
■ Salute	21,65
■ Servizi di Pubblica Utilità	10,24

## Anagrafica

Società di Gestione	State Street Global Advisors Europe Limited	Patrimonio Classe (Mln)	26,63 EUR	Investimento Min. Ingresso	3.000.000 EUR
Telefono	+353 1 776 3000	(11/02/2026)	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo
Web	-		Valuta del Fondo	EUR	0,45%
Data di Partenza	30/03/2016		UCITS	Si	Spese correnti
Nome del Gestore	-		Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo
Data Inizio Gestione	24/03/2010		ISIN	LU1338145581	-
NAV (11/02/2026)	EUR 16,62				

# SSGA Luxembourg SICAV - State Street Global Screened Managed Volatility Equity

Patrimonio Netto (Mln)  
**Fund I EUR Inc**

375,04 USD