

# SSGA Luxembourg SICAV - State Street Sustainable Climate Euro Corporate

Categoria Morningstar™

Bond Fund P-EUR Acc

Benchmark Morningstar

Morningstar Eurozone Corporate Bond GR

Benchmark Dichiarato

Bloomberg Euro Agg Corps TR USD

Morningstar Rating™

★★★

EUR

Usato nel Report

## Obiettivo d'Investimento Dichiarato

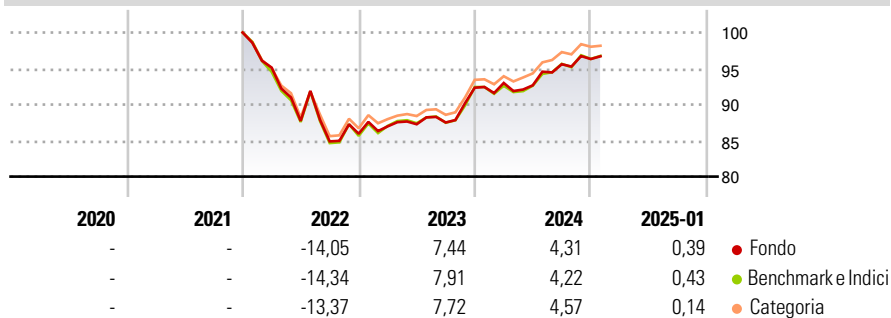
The objective of the Fund is to generate capital growth over the long term through investment in the fixed-rate, investment grade, Euro-denominated corporate bond market. The investment policy of the Fund is to invest in bonds of companies which exhibit lower carbon emissions in the way of current emissions and future emissions (measured by fossil fuel reserves), green labelled and climate-aligned bonds and corporate bonds issued by companies that are better positioned for the risks posed by climate change while screening out securities based on an assessment of their adherence to certain ESG criteria defined by the Investment Manager.

## Misure di Rischio

|                   |       |                 |       |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha          | -0,06 | 3Y Sharpe Ratio | -0,42 |
| 3Y Beta           | 0,97  | 3Y Std Dev      | 6,67  |
| 3Y R-Squared      | 98,64 | 3Y Risk         | Med   |
| 3Y Info Ratio     | 0,02  | 5Y Risk         | -     |
| 3Y Tracking Error | 0,77  | 10Y Risk        | -     |

Basati su Morningstar Eurozone Corporate Bond GR EUR (dove applicabile)

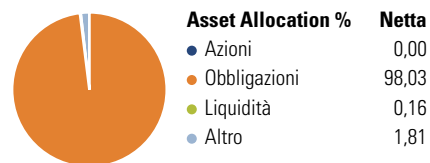
## Rendimenti



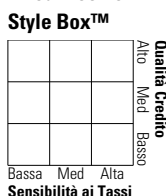
| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk   | Cat  | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2    | Q3    | Q4   |
|------------------|-------|-------|------|--------------------------|-------|-------|-------|------|
| 3-Mesi           | 1,59  | 1,64  | 1,61 | 2025                     | -     | -     | -     | -    |
| 6-Mesi           | 2,49  | 2,48  | 2,55 | 2024                     | 0,71  | -0,35 | 3,17  | 0,76 |
| 1-Anno           | 5,32  | 5,43  | 5,39 | 2023                     | 1,19  | 0,34  | 0,28  | 5,52 |
| 3-Anni Ann.ti    | -0,03 | -0,04 | 0,25 | 2022                     | -4,87 | -7,78 | -3,24 | 1,25 |
| 5-Anni Ann.ti    | -     | -     | -    | 2021                     | -     | -     | -     | -    |
| 10-Anni Ann.ti   | -     | -     | -    |                          |       |       |       |      |

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

## Portafoglio 31/12/2024



## Fixed Income Style Box™



|                       | Fondo |
|-----------------------|-------|
| Duration Effettiva    | -     |
| Maturità effettiva    | -     |
| Qualità Credito Media | -     |

| Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|------------------|------|------------------|------|
|                  | 0    |                  | 0    |

## Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| Orange S.A. 8.125%                          | -       | 0,22  |
| JPMorgan Chase & Co. 1.638%                 | -       | 0,20  |
| NatWest Group PLC 4.067%                    | -       | 0,19  |
| Caixabank S.A. 5.375%                       | -       | 0,19  |
| Banco Santander, S.A. 4.875%                | -       | 0,18  |
| Sodexo S.A. 1%                              | -       | 0,18  |
| Amprion GmbH 3.971%                         | -       | 0,18  |
| LVMH Moët Hennessy Vuitton...               | -       | 0,17  |
| Anheuser-Busch InBev...                     | -       | 0,17  |
| BNP Paribas SA 2.125%                       | -       | 0,17  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 1,84  |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 1.619 |

## Fixed Income Sector Weightings %

|                          | Fondo |
|--------------------------|-------|
| Governativo              | 0,00  |
| Societario               | 99,74 |
| Cartolarizzazioni        | 0,09  |
| Enti Locali              | 0,00  |
| Liquidità ed equivalenti | 0,17  |
| Derivati                 | 0,00  |

## Coupon Range %

|                   | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon          | 1,09  |
| Da 0 a 4 cedole   | 77,84 |
| Da 4 a 6 cedole   | 19,75 |
| Da 6 a 8 cedole   | 1,06  |
| Da 8 a 10 cedole  | 0,26  |
| Da 10 a 12 cedole | 0,00  |
| Oltre 12 cedole   | 0,00  |

## Scadenze %

|            | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 25,70 |
| da 3 a 5   | 26,26 |
| da 5 a 7   | 19,94 |
| da 7 a 10  | 16,79 |
| da 10 a 15 | 4,29  |
| da 15 a 20 | 2,87  |
| da 20 a 30 | 3,52  |
| oltre 30   | 0,27  |

## Anagrafica

|                        |   |                         |              |                              |        |
|------------------------|---|-------------------------|--------------|------------------------------|--------|
| Società di Gestione    | State Street Global Advisors Europe Limited | Patrimonio Classe (Mln) | 11,86 EUR    | Investimento Min. Ingresso   | 50 EUR |
| Telefono               | +353 1 776 3000                             | (04/02/2025)            |              | Investimento Min. Successivo | 50 EUR |
| Web                    | -   | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | 0,53%  |
| Data di Partenza       | 03/12/2021                                  | Valuta del Fondo        | EUR          | Spese correnti               | 0,49%  |
| Nome del Gestore       | -   | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | -      |
| Data Inizio Gestione   | -   | Inc/Acc                 | Acc          |                              |        |
| NAV (04/02/2025)       | EUR 9,63                                    | ISIN                    | LU2373031215 |                              |        |
| Patrimonio Netto (Mln) | 295,11 EUR                                  |                         |              |                              |        |

(31/12/2024)