

State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund

State Street Global
Advisors Luxembourg
SICAV

Anlageziel des Fonds

Das Ziel des Fonds besteht darin, die Performance des Markts für festverzinsliche, auf Euro lautende, nachhaltige Investment-Grade-Unternehmensanleihen nachzubilden.

Umwelt, Soziales & Unternehmensführung (ESG)

Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, verfolgt aber nachhaltige Investitionen nicht als eines seiner Ziele. Der Fonds wurde nach Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („Offenlegungsverordnung“) eingestuft.

Die wichtigsten methodischen Einschränkungen: Es ist möglich, dass ESG-Daten unstimmtig, ungenau oder nicht ausreichend verfügbar sind, insbesondere wenn diese Angaben von externen Datenanbietern eingeholt werden. Die Einschränkungen sind im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Weitere Informationen zu den ESG-Merkmalen, der ESG-Strategie, dem Investmentprozess und dem angewandten Ansatz finden Sie im Prospekt.

Anlagestrategie

Die Anlagepolitik des Fonds sieht vor, die Performance des Markt iBoxx Euro SRI Corporate Bond Custom Index (oder eines anderen Index, der vom Verwaltungsrat jeweils festgelegt wird und im Wesentlichen denselben Markt wie der Index abbildet) so genau wie möglich nachzubilden und dabei den Nachbildungsunterschied zwischen der Performance des Fonds und jener des Index so gering wie möglich zu halten.

Der Index misst die Performance des Euro-Unternehmensanleihenmarkts, mit Titelauswahl auf der Grundlage von Nachhaltigkeitskriterien. Wertpapiere müssen festverzinslich sein, auf Euro lauten und mit „Investment Grade“ bewertet sein, wie

durch die Indexmethodik definiert. Die Aufnahme basiert auf der Währung der Emission, nicht auf dem Sitz des Emittenten.

Fondsinformationen

Anteilsklasse	[B] Institutional Investors who have entered into a Qualifying Agreement
Benchmark	Markit iBoxx Euro SRI Corporate Bond Custom Index
Struktur	Investment Company
UCITS-konform	Ja
Domizil	Luxemburg

Fondsdaten

ISIN	LU0773064638
NAV	10,20 EUR per 30 Juni 2026
Währung	EUR
Fondsvolumen (NAV) (Mio.)	539,34 EUR per 30 Juni 2026
Auflagedatum	01 April 2026
SFDR-Fondsklassifizierung	SFDR – Artikel 8
Anlagestil	Index
Land/Region	Economic Monetary Union/Eurozone
Abrechnung	Zyklus für die Abrechnung von Rücknahmen, DD+2; Zyklus für die Abrechnung von Zeichnungen, DD+2
Mitteilungsfrist	DD 11:00 Uhr MEZ
Bewertung	Täglich, Börsenschluss
Swingfaktor ¹	
Kauf	0,20%
Verkauf	0,00%
Einmalanlage	EUR 10 000 000,00
Folgeinvestments	EUR 5 000,00
Managementgebühren	0%
Tatsächliche TER	k.A.
Gebühren, die an den Fonds gezahlt wurden	Kauf: k.A. Verkauf: Bis zu 0%

¹ Anhaltspunkt zum Datum dieses Factsheets, Änderungen vorbehalten

Die Wertentwicklung des Fonds ist nicht angegeben, da die Auflegung des Fonds vor weniger als 12 Monaten erfolgte.

Eine Anlage ist mit Risiken verbunden, einschließlich des Risikos eines Kapitalverlusts.

Merkmale		
	Fonds	Benchmark
Anzahl der Vermögenswerte*	2 834	3 357
Durchschnittliche (optionsbereinigte) Endfälligkeitsrendite (%)	3,42	3,42
Rückzahlungsrendite (%)	3,51	3,51
Laufende Rendite (%)	3,08	3,04
Durchschnittlicher Kupon (%)	3,06	3,03
Optionsbereinigter Spread (in Basispunkten)	79,75	79,29
Effektive Duration (Jahre)	4,57	4,56
Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre)	5,24	5,22
Effektive Konvexität	0,30	0,30
Durchschnittliches Rating	BAA1	BAA1

* Die Anzahl von dem Fond notierten Emissionen kann cash positionen enthalten.

Kennzahlen		3 Jahre
Standardabweichung (%)	-	
Tracking Error (%)	-	
Beta	-	

Länder		
	Fonds (%)	Benchmark (%)
USA	19,90	19,83
Frankreich	18,03	18,15
Deutschland	11,42	11,86
Großbritannien	9,40	9,17
Niederlande	6,58	6,43
Spanien	6,53	6,52
Italien	5,81	5,87
Schweden	2,83	2,85
Belgien	2,71	2,68
Dänemark	2,48	2,48
Andere	14,31	14,16
Gesamt	100,00	100,00

Branchen		
	Fonds (%)	Benchmark (%)
Finanzsektor	43,62	43,63
Industrien	39,80	39,85
Versorger	8,65	8,60
Agent	4,44	4,31
Andere	2,03	2,12
Non Corporates	1,43	1,49
Cash	0,04	-
Gesamt	100,00	100,00

Kreditrating-Positionen		
	Fonds (%)	Benchmark (%)
Aaa	0,14	0,07
Aa	7,62	7,73
A	42,95	43,10
Baa	49,17	48,95
Unterhalb der BAA	0,07	0,14
Nicht geratet	0,05	0,02
Gesamt	100,00	100,00

Fälligkeiten		
	Fonds (%)	Benchmark (%)
0 - 1 Jahr	0,11	0,02
1 - 3 Jahre	27,49	28,76
3 - 5 Jahre	29,58	28,48
5 - 7 Jahre	21,02	20,49
7 - 10 Jahre	15,56	15,62
10 - 20 Jahre	5,66	6,10
> 20 Jahre	0,58	0,54

Quelle: State Street Investment Management.
Die angegebenen Merkmale, Kreditrating-Positionen, Länderallokationen und Sektoren beziehen sich auf das ganz oben auf diesem Factsheet angegebene Datum und können sich ändern.
„Sonstige“ bezeichnet bei Ländern den Zusammenschluss von Ländern, die nicht bereits in den Top-10 des Fonds enthalten sind.
Die Bonitätsbewertung basiert auf einem Durchschnitt von Moody's, S & P und Fitch.
Bitte beachten Sie, dass vollständige einzelheiten zu den dem fonds zugrunde liegenden beständen auf statestreet.com/im enthalten sind

Kontaktieren Sie uns

Besuchen Sie unsere Website statestreet.com/im oder wenden Sie sich an Ihre State Street Investment Management-Niederlassung vor Ort.

Belgium +32 (0) 2 663 2016	Middle East & Africa +971 2 245 9000
France +33 (0) 1 44 45 40 48	Netherlands +31 (0) 20 718 1701
Germany +49 (0) 89 55878 999	Switzerland +41 (0) 44 245 7099
Ireland +353 (1) 776 3000	United Kingdom +44 (0) 20 3395 2333
Italy +39 02 3206 6121	

statestreet.com/im

Marketingmitteilung
Allgemeiner Zugang. Nur für
professionelle Kunden.

State Street Global Advisors (SSGA) heisst
jetzt State Street Investment Management.
Bitte besuchen Sie unsere Website
[statestreet.com/investment-management](https://www.statestreet.com/investment-management)
für weitere Informationen.

Dieses Material dient Ihrer persönlichen
Information. Die hier erteilten Informationen
stellen keine Anlageberatung gemäß Definition
nach der Richtlinie über Märkte für
Finanzinstrumente (2014/65/EU) oder
geltenden Schweizer Vorschriften dar und
sollten nicht als Grundlage für eine

Anlageentscheidung herangezogen werden. Es
werden keine Erklärungen oder Zusicherungen
bezüglich der Richtigkeit der Informationen
abgegeben, und State Street haftet nicht für
Entscheidungen, die auf Basis dieser
Informationen getroffen werden.

Bitte lesen Sie die aktuellen wesentlichen
Anlegerinformationen (WAI) und den
Prospekt des Fonds, bevor Sie eine
endgültige Anlageentscheidung treffen.
Die aktuelle englische Fassung des
Prospekts und der WAI finden Sie unter
www.statestreet.com/im. Eine
Zusammenfassung der Anlegerrechte
finden Sie hier: <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights/ssga-investors-rights-summary-template-non-etf-Lux.pdf> Beachten Sie, dass die
Verwaltungsgesellschaft beschließen

kann, die für die Vermarktung getroffenen
Vereinbarungen zu beenden und die
Notifizierung gemäß Artikel 93a der
Richtlinie 2009/65/EG zu löschen.

Diese Informationen sind für professionelle
Kunden bestimmt (wozu auch geeignete
Gegenparteien gehören), die sowohl als
sachkundig sowie als erfahren in
Angelegenheiten im Zusammenhang mit
Anlagen gelten.

Bei den in dieser Kommunikation
enthaltenen Informationen handelt es sich
nicht um eine Analystenempfehlung oder
„Investment Research“, sie sind vielmehr
im Sinne anwendbarer aufsichtsrechtlicher
Vorgaben als „Marketingmitteilung“
klassifiziert. Dies bedeutet, dass diese
Marketingmitteilung (a) nicht gemäß
Rechtsvorschriften erstellt wurde, die die
Unabhängigkeit von Investment Research

fördern sollen, und (b) keinem zeitlichen
Handelsverbot in Bezug auf den Handel vor
der Verbreitung von Investment Research
unterliegt.

Der Markit "iBoxx" Euro Sustainable Corporate
Bond Custom Index, auf den hierin Bezug
genommen wird, ist Eigentum der Markit Indices
Limited und wird unter Lizenz verwendet.
Dieses Werk darf ohne ausdrückliche
schriftliche Einwilligung von State Street
Investment Management weder ganz noch
teilweise vervielfältigt, kopiert oder übertragen
und sein Inhalt gegenüber Dritten nicht offen
gelegt werden.

© 2026 State Street Corporation.
Alle Rechte vorbehalten.
Tracking Number: 9052810.1.1.EMEA.INST
Fälligkeit: 19/08/2026