

# State Street EMU Government Bond Index Fund

State Street Global  
Advisors Luxembourg  
SICAV

Informationsblatt

30 November 2025

## Renten



Morningstar Rating™

Per 30 November 2025

### Anlageziel des Fonds

Das Ziel des Fonds besteht darin, die Performance des Euro-Staatsanleihenmarkts nachzubilden.

### Anlagestrategie

Die Anlagepolitik des Fonds sieht vor, die Performance des FTSE EMU Government Bond 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-Staatsanleihenmarkts. Wertpapiere müssen festverzinslich und mit „Investment Grade“ bewertet sein, wie durch die Indexmethodik definiert.

### Fondsinformationen

Anteilkategorie	[B] Institutional Investors who have entered into a Qualifying Agreement
Benchmark	FTSE EMU Government Bond Index
Struktur	Investment Company
UCITS-konform	Ja
Domizil	Luxemburg

### Fondsdaten

ISIN	LU0773065015
NAV	12,29 EUR per 28 November 2025
Währung	EUR
Fondsvolumen (NAV) (Mio.)	329,84 EUR per 28 November 2025
Auflagedatum	12 September 2012
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 <sup>1</sup>	
Kauf	0,03%
Verkauf	0,00%
Einmalanlage	EUR 10 000 000,00
Folgeinvestments	EUR 5 000,00
Managementgebühren	0%
Tatsächliche TER	0,05%
Gebühren, die an den Fonds gezahlt wurden	Kauf: k.A Verkauf: Bis zu 2%

<sup>1</sup> Anhaltspunkt zum Datum dieses Factsheets, Änderungen vorbehalten

## Wertentwicklung

	Benchmark	Fonds vor Kosten (brutto)	Differenz	Fonds nach Kosten (netto)	Differenz
<b>Annualisiert (%)</b>					
1 Jahr	-0,25	-0,21	0,04	-0,22	0,02
3 Jahre	1,72	1,79	0,07	1,78	0,06
5 Jahre	-2,76	-2,72	0,04	-2,75	0,02
Seit Auflage	1,59	1,62	0,02	1,57	-0,02
<b>Kumuliert (%)</b>					
1 Monat	-0,04	-0,04	0,00	-0,01	0,03
3 Monate	1,34	1,36	0,01	1,37	0,03
1 Jahr	-0,25	-0,21	0,04	-0,22	0,02
3 Jahre	5,24	5,47	0,23	5,43	0,19
5 Jahre	-13,08	-12,88	0,20	-13,00	0,08
Seit Auflage	23,25	23,64	0,39	22,85	-0,40
<b>Kalenderjahr (%)</b>					
2025 (YTD)	1,17	1,28	0,11	1,27	0,09
2024	1,86	1,79	-0,07	1,76	-0,10
2023	7,16	7,35	0,19	7,40	0,24
2022	-18,52	-18,50	0,02	-18,54	-0,02
2021	-3,54	-3,55	-0,01	-3,60	-0,06

**Die Wertentwicklung der Vergangenheit ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse.**

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

Die hierin enthaltenen Zahlen zur Wertentwicklung werden vor und nach Abzug von Gebühren angegeben. Der Abzug von Gebühren berücksichtigt nicht den Abzug von Beratungs- oder sonstigen Gebühren, welche die Rendite schmälern könnten. Die Indexrenditen reflektieren Kapitalgewinne und -verluste, Erträge und die Wiederanlage von Dividenden. Die Wertentwicklung berücksichtigt die Wiederaufnahme von Dividenden und sonstigen Unternehmensgewinnen und wird in der Währung berechnet, die in den Fondsdaten angegeben ist.

Für das Kalenderjahr, in das das Auflegungsdatum entweder des betreffenden Fonds oder des an die vergangene Wertentwicklung gebundenen Fonds fällt (je nachdem welches das frühere Datum ist), ist die Angabe der Wertentwicklung im Kalenderjahr unvollständig.

Die Berechnungsmethode für Value-Added-Renditen kann Rundungsdifferenzen aufweisen.

Sind bei einer Schließung des Fonds gemäß seinem offiziellen Nettoinventarwert (NAV)-Kalender Preise für einen maßgeblichen Teil der zugrunde liegenden Wertpapiere ermittelbar, so wird ein technischer NAV berechnet. Die angegebene frühere Wertentwicklung wurde daher erforderlichenfalls auf Grundlage eines technischen NAV und des offiziellen NAV des Fonds zu jedem anderen Geschäftstag des betreffenden Zeitraums berechnet.

Bitte beachten Sie, dass bis zum 12. September 2013 der Barclays Euro Treasury Bond Index der Referenzindex war.

Quelle: State Street Investment Management.

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 30/11/2025

## Merkmale

	Fonds	Benchmark
Anzahl der Vermögenswerte*	387	410
Durchschnittliche (optionsbereinigte) Endfälligkeitserendite (%)	2,81	2,80
Rückzahlungsrendite (%)	2,81	2,80
Laufende Rendite (%)	2,76	2,65
Durchschnittlicher Kupon (%)	2,54	2,38
Optionsbereinigter Spread (in Basispunkten)	33,33	32,87
Effektive Duration (Jahre)	7,15	7,15
Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre)	8,80	8,74
Effektive Konvexität	0,96	0,97
Durchschnittliches Rating	A1	A1

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

## Kennzahlen

	3 Jahre
Standardabweichung (%)	5,72
Tracking Error (%)	0,08
Beta	1,00

## Länder

	Fonds (%)	Benchmark (%)
Frankreich	24,43	24,45
Italien	23,08	23,10
Deutschland	19,55	19,57
Spanien	14,60	14,62
Belgien	5,13	5,14
Niederlande	4,27	4,29
Österreich	3,62	3,60
Portugal	1,99	2,01
Finnland	1,78	1,76
Irland	1,46	1,45
Andere	0,10	0,00
<b>Gesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

## Branchen

	Fonds (%)	Benchmark (%)
Staatsanleihen	99,90	100,00
Cash	0,10	-
<b>Gesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

## Kreditrating-Positionen

	Fonds (%)	Benchmark (%)
Aaa	23,92	23,86
Aa	11,98	11,95
A	41,02	41,09
Baa	23,08	23,10
<b>Gesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

## Fälligkeiten

	Fonds (%)	Benchmark (%)
0 - 1 Jahr	0,10	-
1 - 3 Jahre	21,44	22,27
3 - 5 Jahre	20,10	19,85
5 - 7 Jahre	12,94	13,63
7 - 10 Jahre	18,64	17,89
10 - 20 Jahre	16,11	16,04
> 20 Jahre	10,66	10,32

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](http://statestreet.com/im) enthalten sind**

## Kontaktieren Sie uns

Besuchen Sie unsere Website [statestreet.com/im](http://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](http://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](http://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 Prospектs und der WAI finden Sie unter [www.statestreet.com/im](http://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.**

**Diese kollektive Kapitalanlage und ihre Vertriebsstelle sind von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht (FINMA) nach dem Kollektivanlagengegesetz (KAG) und der Schweizer Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (Kollektivanlagenverordnung, KKV) zugelassen. Die kollektive Kapitalanlage wurde nach dem Recht Luxemburgs als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) strukturiert und ist als OGAW von der Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) zugelassen. Potenzielle Anleger können den aktuellen Prospekt, die Satzung, die wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) sowie den letzten Jahres- und Halbjahresbericht kostenlos von der Vertretung und Zahlstelle in der Schweiz, State Street Bank International GmbH, München, Niederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, CH-8027 Zürich, beziehen.**

© 2025 Morningstar, Inc. Alle Rechte vorbehalten. Die hierin enthaltenen Informationen: (1) sind geschützte Informationen von Morningstar und/oder ihren Content-Anbietern; (2) dürfen nicht vervielfältigt oder weitergegeben werden; und (3) ihre Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität kann nicht zugesichert werden. Weder Morningstar noch seine Content-Anbieter haften für Schäden oder Verluste, die aus der Verwendung dieser Informationen resultieren.

CITIGROUP ist eine eingetragene Marke und Dienstleistungsmarke von Citigroup Inc. oder ihren verbundenen Unternehmen, die weltweit verwendet wird und weltweit registriert ist. Der Citi EMU Government Bond Index („Index“) ist Eigentum der Citigroup Index LLC („Citigroup“) und wird von dieser verwaltet. Alle Indexten © Citigroup Index LLC 2013. Alle Rechte vorbehalten.

Dieses Werk darf ohne ausdrückliche schriftliche Einwilligung von SSGA weder ganz noch teilweise vervielfältigt, kopiert oder übertragen und sein Inhalt gegenüber Dritten nicht offen gelegt werden.

© 2025 State Street Corporation.  
Alle Rechte vorbehalten.  
Fälligkeit: 19/01/2026