

State Street US Screened Index Equity Fund

State Street Global
Advisors Luxembourg
SICAV

Informationsblatt

30 November 2025

Aktien



Morningstar Rating™

Per 30 November 2025

Anlageziel des Fonds

Das Ziel des Fonds besteht darin, die Performance des US-amerikanischen Aktienmarkts nachzubilden.

Umwelt, Soziales & Unternehmensführun (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 unstimmig, 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

Der State Street US Screened Index Equity Fund („Fonds“) ist ein Indexfonds, der die Wertentwicklung des MSCI USA Screened Choice Index („Index“) nachbildet. Die ökologischen und soziale Merkmale werden beworben, indem auf den vom Fonds bestimmten Index ein normenbasiertes Negativ-Screening angewandt wird, um Wertpapiere auf Basis einer Beurteilung ihrer Einhaltung von ESG-Kriterien auszufiltern. Der Index repräsentiert die Wertentwicklung des breiten US-Aktienmarktes und schließt dabei Unternehmen aus, die mit kontroversen Waffen, Atomwaffen, zivilen Feuerwaffen, der Gewinnung fossiler Brennstoffe, der Verstromung von Kraftwerkskohle und mit Tabak in Verbindung gebracht werden oder die Grundsätze des United Nations Global Compact („UNG“) nicht einhalten.

Fondsinformationen

Anteilkategorie	[I] Institutionelle Investoren
Benchmark	MSCI USA Screened Choice Index
Struktur	Investment Company
UCITS-konform	Ja
Domizil	Luxemburg

Fondsdaten

ISIN	LU1159236840
NAV	39,55 USD per 28 November 2025
Währung	USD
Fondsvolumen (NAV) (Mio.)	1 777,63 USD per 28 November 2025
Auflagedatum	28 September 2015
SFDR-Fondsklassifizierung	SFDR – Artikel 8
Anlagestil	Index
Land/Region	USA
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	0,00%
Verkauf	0,00%
Einmalanlage	USD 3 000 000,00
Folgeinvestments	USD 1 000,00
Managementgebühren	0,2%
Tatsächliche TER	0,24%
Gebühren, die an den Fonds gezahlt wurden	Kauf: k.A Verkauf: Bis zu 0%

¹ Anhaltspunkt zum Datum dieses Factsheets, Änderungen vorbehalten

Wertentwicklung

	Benchmark	Fonds vor Kosten (brutto)	Differenz	Fonds nach Kosten (netto)	Differenz
Annualisiert (%)					
1 Jahr	14,83	14,94	0,10	14,66	-0,17
3 Jahre	20,64	20,69	0,05	20,40	-0,24
5 Jahre	14,51	14,56	0,05	14,28	-0,23
Seit Auflage	9,19	9,42	0,23	9,03	-0,16
Kumuliert (%)					
1 Monat	-0,02	-0,02	0,00	-0,04	-0,02
3 Monate	6,45	6,45	0,00	6,39	-0,06
1 Jahr	14,83	14,94	0,10	14,66	-0,17
3 Jahre	75,61	75,82	0,22	74,58	-1,03
5 Jahre	96,88	97,34	0,46	94,94	-1,93
Seit Auflage	1161,67		79,55		-51,83
Kalenderjahr (%)					
2025 (YTD)	17,54	17,64	0,09	17,38	-0,16
2024	25,45	25,41	-0,04	25,11	-0,34
2023	26,69	26,79	0,11	26,48	-0,20
2022	-20,13	-20,08	0,05	-20,28	-0,15
2021	26,77	26,84	0,07	26,53	-0,24

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.

Dieser Fonds hat aufgrund der Zusammenlegung mit dem SSgA US Index Equity Fund mit Sitz in Frankreich ein neues Auflegungsdatum zum 28. September 2015. Die Tabelle und die Grafik zur Wertentwicklung bilden historische Daten ab dem 31. Januar 1997 ab.

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.

Vor dem 1 Januar 2023 war der Fonds unter der Bezeichnung State Street US ESG Screened Index Equity Fund.

Vor dem 1 Juni 2024 war die Benchmark des Fonds der MSCI USA EX UNGC AND CW CUST INDEX.

Vor dem 30 April 2025 war die Benchmark des Fonds der MSCI USA ESG Screened Choice Index.

Quelle: State Street Investment Management.

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 30/11/2025

Merkmale

	Fonds	Benchmark
Durchschnittlich gewichtete Marktkapitalisierung (in Mio.)	US\$1 455 004	US\$1 454 430
Durchschnittliches Preis/Buch-Verhältnis	5,41	5,41
Erwartetes KGV (nächste 12 Monate)	28,55	28,54
Gewichtetes Preis/Cash Flow Verhältnis	22,14	22,13
Dividendenrendite (%)	1,06	1,06
Anzahl der Vermögenswerte*	504	504

* Die Anzahl von den Fonds notierten Stammaktien kann cash Positionen enthalten.

Kennzahlen

	3 Jahre
Standardabweichung (%)	13,05
Tracking Error (%)	0,04
Beta	1,00

Top-10-Positionen

	Gewichtung (%)
NVIDIA CORP	7,53
APPLE INC	7,25
MICROSOFT CORP	6,09
AMAZON.COM INC	3,92
ALPHABET INC-CL A	3,27
BROADCOM INC	3,17
ALPHABET INC-CL C	2,74
META PLATFORMS INC-CLASS A	2,47
TESLA INC	2,13
ELI LILLY & CO	1,52

Branchen

	Fonds (%)
Informationstechnologie	35,84
Finanzen	13,32
Kommunikationsdienste	11,26
Nicht-Basiskonsumgüter	10,76
Gesundheitswesen	10,28
Industrieunternehmen	7,20
Basiskonsumgüter	4,34
Immobilien	2,02
Material	1,90
Energie	1,74
Versorgungsunternehmen	1,32
Gesamt	100,00

Länder

	Fonds (%)
USA	100,00
Gesamt	100,00

Quelle: State Street Investment Management.

Die angegebenen Merkmale, Bestände, 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.

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 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.

Diese kollektive Kapitalanlage und ihre Vertriebsstelle sind von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht (FINMA) nach dem Kollektivvertragsgesetz (KAG) und der Schweizer Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (Kollektivvertragverordnung, 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. 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