

Aktien

31 Juli 2024

**Anteilsklasse**

[P] Alle Anleger

**Anlageziel des Fonds**

Das Ziel des Fonds besteht darin, die Performance des Schweizer Aktienmarkts nachzubilden.

**Anlagestrategie**

Die Anlagepolitik des Fonds sieht vor, die Performance des MSCI Switzerland ESG Screened Choice 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 von Schweizer Aktien. Wertpapiere werden nach der Marktkapitalisierung gewichtet, nachdem Wertpapiere auf der Grundlage einer Beurteilung ihrer Einhaltung von ESG-Kriterien.

**Benchmark**

MSCI SWITZERLAND ESG SCREENED CHOICE INDEX

**Struktur**

Investment Company

**UCITS-konform****Domizil**

Luxemburg

**Fondsdaten**

<b>ISIN</b>	LU1159239273
<b>NAV</b>	16,50 CHF per 31 Juli 2024
<b>Währung</b>	CHF
<b>Fondsvolumen (NAV) (Mio.)</b>	179,93 CHF per 31 Juli 2024
<b>Auflagedatum</b>	28 September 2015
<b>Anlagestil</b>	Index
<b>Land/Region</b>	Schweiz
<b>Abrechnung</b>	Zyklus für die Abrechnung von Rücknahmen, DD+2; Zyklus für die Abrechnung von Zeichnungen, DD+2
<b>Mitteilungsfrist</b>	DD 11:00 Uhr MEZ
<b>Bewertung</b>	Täglich, Börsenschluss
<b>Swingfaktor<sup>1</sup></b>	
<b>Kauf</b>	0,02%
<b>Verkauf</b>	0,02%
<b>Einmalanlage</b>	CHF 50,00
<b>Folgeinvestments</b>	CHF 50,00
<b>Managementgebühren</b>	0,6%
<b>Tatsächliche TER</b>	0,69%
<b>Kosten</b>	<b>Kauf</b> <b>Verkauf</b>
<b>Zahlbar an den Fonds</b>	k.A. Bis zu 2%

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

**Wertentwicklung**

Annualisiert	Benchmark	Fonds vor Kosten (brutto)	Differenz	Fonds nach Kosten (netto)	Differenz
1 Jahr (%)	9,53	9,59	0,06	8,79	-0,74
3 Jahre (%)	1,29	1,36	0,07	0,65	-0,63
5 Jahre (%)	5,44	5,52	0,08	4,79	-0,66
Seit Auflage (%)	5,78	6,09	0,31	5,40	-0,38
<b>Kumuliert</b>					
1 Monat (%)	3,07	3,07	0,00	3,01	-0,06
3 Monate (%)	9,34	9,36	0,03	9,15	-0,19
1 Jahr (%)	9,53	9,59	0,06	8,79	-0,74
3 Jahre (%)	3,91	4,13	0,22	1,97	-1,94
5 Jahre (%)	30,37	30,84	0,47	26,35	-4,02
Seit Auflage (%)	369,26	408,22	38,96	324,88	-44,38
<b>Kalenderjahr</b>					
2024 (seit Jahresbeginn)	12,13	12,20	0,07	11,72	-0,41
2023	5,26	5,37	0,11	4,64	-0,61
2022	-17,06	-16,98	0,07	-17,56	-0,50
2021	22,97	22,91	-0,06	22,06	-0,90
2020	1,91	2,05	0,14	1,34	-0,57

**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 Wiederanlage 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 Switzerland 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.

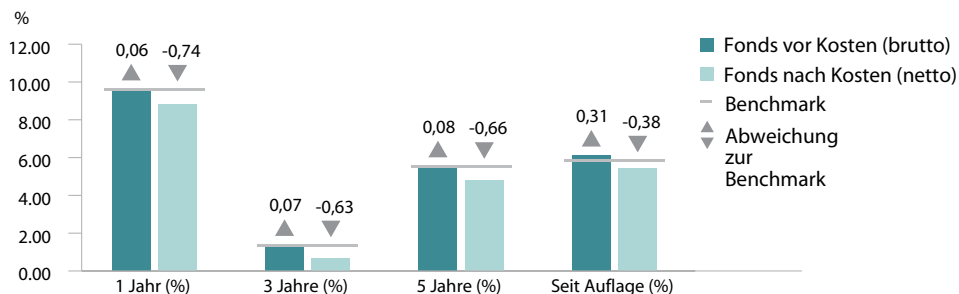
Die Berechnungsmethode für Value-Added-Renditen kann Rundungsdifferenzen aufweisen.

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 Juni 2024 war der Fonds unter der Bezeichnung State Street Switzerland Index Equity Fund bekannt und bildete den MSCI Switzerland Index nach.

Quelle: SSGA.

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 31/07/2024

**Annualisierte Wertentwicklung****Fondsmerkmale**

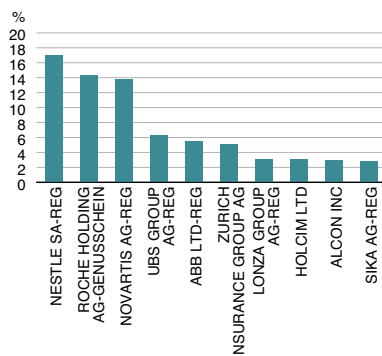
	Fonds	Benchmark
Durchschnittlich gewichtete Marktkapitalisierung (in Mio.)	Fr119 310	Fr119 387
Durchschnittliches Preis/Buch-Verhältnis	3,82	3,81
Erwartetes KGV (nächste 12 Monate)	18,51	18,49
Gewichtetes Preis/Cash Flow Verhältnis	12,69	12,67
Dividendenrendite (%)	2,97	2,97
Anzahl der Vermögenswerte*	42	42

**Kennzahlen**

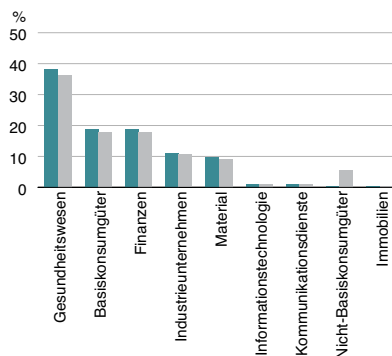
	3 Jahre
Standardabweichung (%)	12,78
Tracking Error (%)	0,06
Beta	1,00

\* Die Anzahl von dem Fond notierten Stammaktien kann cash Positionen enthalten.

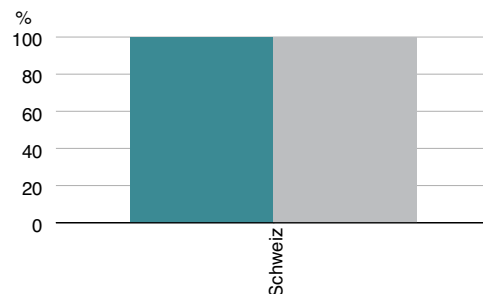
Top-10-Positionen	Gewichtung (%)
NESTLE SA-REG	17,00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14,34
NOVARTIS AG-REG	13,87
UBS GROUP AG-REG	6,26
ABB LTD-REG	5,57
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,05
LONZA GROUP AG-REG	3,12
HOLCIM LTD	3,06
ALCON INC	2,97
SIKA AG-REG	2,90



Branchen	Fonds (%)	Benchmark (%)
Gesundheitswesen	38,21	36,26
Basiskonsumgüter	18,95	17,99
Finanzen	18,77	17,80
Industrieunternehmen	11,17	10,59
Material	9,77	9,28
Informationstechnologie	1,16	1,10
Kommunikationsdienste	1,00	0,94
Nicht-Basiskonsumgüter	0,49	5,57
Immobilien	0,49	0,46
<b>Gesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



Länder	Fonds (%)	Benchmark (%)
Schweiz	100,00	100,00
<b>Gesamt</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



**Für weitere Informationen**  
Besuchen Sie unsere Website [www.ssga.com](http://www.ssga.com) oder wenden Sie sich an Ihre SSGA-Niederlassung vor Ort.

**SSGA Belgien**

+32 (0) 2 663 2016

**SSGA Frankreich**

+33 (0) 1 44 45 40 48

**SSGA Deutschland**

+49 (0) 89 55878 999

**SSGA Irland**

+353 (87) 469 8361

**SSGA Italien**

+39 02 3206 6121

**SSGA Middle East & Africa**

+971 2 245 9000

**SSGA Niederlande**

+31 (0) 20 718 1701

**SSGA Schweiz**

+41 (0) 44 245 7099

**SSGA Vereinigtes Königreich**

+44 (0) 20 3395 2333

Quelle: SSGA.

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 [WWW.SSGA.COM](http://WWW.SSGA.COM) ENHALTEN SIND**

**Marketingmitteilung – Allgemeiner Zugang. Nur für professionelle Kunden.**

**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.ssga.com](http://www.ssga.com). 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 „Anlageresearch“, sie sind vielmehr gemäß der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente (2014/65/EU) oder geltenden Schweizer Vorschriften als „Marketingmitteilung“ klassifiziert. Dies bedeutet, dass diese Marketingmitteilung (a) nicht gemäß Rechtsvorschriften erstellt wurde, die die Unabhängigkeit von Anlageresearch fördern sollen, (b) keinem Verbot in Bezug auf den Handel vor der Verbreitung von Anlageresearch unterliegt.**

**Diese kollektive Kapitalanlage und ihre Vertriebsstelle sind von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht (FINMA) nach dem Kollektivanlagengesetz (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.**

Die hierin erwähnten Marken und Dienstleistungsmarken sind Eigentum ihrer jeweiligen Inhaber. Unabhängige Datendienste machen keinerlei Zusicherungen oder Garantien bezüglich der Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität der Daten und haften nicht für Schäden jeglicher Art im Zusammenhang mit der Nutzung dieser Daten.

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.

MSCI Switzerland Index ist eine Marke von MSCI Inc.

Die nachstehend dargestellten Nachhaltigkeitsinformationen sollen den Anlegern Transparenz über die Nachhaltigkeitsmerkmale des Fonds bieten. Die Darstellung dieser Informationen sollte weder als Darstellung des aktuellen oder zukünftigen Anlageziels des Fonds verstanden werden, noch sollte sie als Indikator für die aktuelle oder zukünftige Anlageentscheidung des Fondsmanagers angesehen werden.

Für Informationen zur SFDR-Kategorie des Fonds werden Anleger gebeten, den [Prospekt/KIID] des Fonds zu lesen. **Hinweis zu Artikel 6-Fonds: Der Fonds strebt nicht danach, eine nachhaltige Anlage- oder Impact-Strategie zu verfolgen, und alle unten aufgeführten Informationen zu den Nachhaltigkeitsmerkmalen des Fonds dienen nur zu Informationszwecken.**

Anleger sollten eine Anlage in den Fonds nicht ausschließlich auf der Grundlage der unten genannten Informationen bewerten, sondern vielmehr andere Faktoren berücksichtigen, darunter das allgemeine Anlageziel und das Risikoprofil des Fonds. Anlegern wird empfohlen, den [ <https://www.ssga.com/fund-finder?tab=documents> ] des Fonds zu lesen, um weitere Informationen über den Fonds zu erhalten.

Die unten genannten Informationen Dritter stammen aus Quellen, die zum angegebenen Datum als zuverlässig galten, ihre Richtigkeit wird jedoch nicht garantiert. SSGA übernimmt keine Haftung für Investitionsentscheidungen, die auf diesen Informationen basieren, und man sollte sich nicht auf sie als solche verlassen. Es gibt keine Zusicherung oder Garantie hinsichtlich der aktuellen Richtigkeit, Zuverlässigkeit oder Vollständigkeit dieser Informationen.

## Klima-Kennzahlen

Klima-Kennzahlen	Fonds
CO2-Intensität (Direkt + Indirekt)	161,67
Gewichtete durchschnittliche CO2-Intensität (Direkt + Indirekt)	200,21
Gesamtreserven Kohlenstoffemissionen	0,00
Kategorien 1 + 2 Kohlenstoffemissionen	3806035,09
TCFD – Gesamte Kohlenstoffemissionen**	11 830,52*
TCFD – CO2-Bilanz	58,34
TCFD – Kohlenstoffintensität	183,35
TCFD – Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (WACI)	107,86
Braune Einnahmen in %	0,08
Grüne Einnahmen in %	0,12

Detaillierte Hinweise zur Behandlung fehlender Daten, Datenverzögerung und Ausschlüsse finden Sie im „Glossar“. Quelle: State Street Global Advisors, S&P Trucost, FactSet, Task Force on Climate-related Financial Disclosures (TCFD). Bei den Ergebnissen handelt es sich um Schätzungen, die auf Annahmen und Analysen von State Street Global Advisors basieren. Sie sollen nicht die tatsächlichen Ergebnisse eines Angebots darstellen. Die tatsächlichen Ergebnisse können abweichen. \* Die TCFD-Metrik „Total Carbon Emission“ weist den Anlegern Emissionen auf der Grundlage eines Kapitalbeteiligungsansatzes zu. Bei Publikumsfonds stellen die Ergebnisse die Umweltverantwortung des gesamten verwalteten Fondsvermögens dar. Für die Verantwortung einzelner Anteilhaber kann eine anteilige Verantwortung auf der Grundlage des individuellen Beteiligungsprozentsatzes berechnet werden. \*\* Die Kennzahlen werden nicht zum Vergleich von Portfolios und Benchmarks verwendet, da die Daten nicht normalisiert sind.

## Stewardship-Profil

Per 31 Jul 2024

## Stewardship-Profil

Q2 2024

<b>Anzahl der Versammlungen mit Stimmabgabe</b>	28
<b>Anzahl der Länder</b>	1
<b>Vorschläge des Managements</b>	705
Stimmen „Dafür“	84,54%
Stimmen „Dagegen“	15,46%
<b>Vorschläge der Aktionäre</b>	5
Für das Management	40,00%
Gegen das Management	60,00%

Die Zahlen beruhen auf dem allgemein von State Street Global Advisors verfolgten Ansatz zur Stimmabgabe bei den vom Fonds zu Quartalsende gehaltenen Unternehmen. Diese Angaben ersetzen nicht den Bericht über die Stimmabgabe, der über Ihren Kundenbetreuer angefordert werden kann.

Das Asset-Stewardship-Programm von State Street Global Advisors (SSGA) soll mit unseren Fondsunternehmen in Dialog treten zu Fragen, die sich bei allen Aspekten im Zusammenhang mit Umwelt, Sozialem und Governance (ESG) auf die langfristige Wertschöpfung auswirken. In der jüngeren Vergangenheit hat SSGA ausführliche Vorgaben zu maßgeblichen Governance-Sachverhalten herausgegeben wie effektive unabhängige Führung durch den Verwaltungsrat. Derzeit liegt der Fokus von SSGA darauf, Verwaltungsratsgremien dabei zu unterstützen, über potenzielle Auswirkungen ökologischer und sozialer Fragen nachzudenken und bei ihrer Aufsicht über die langfristige Strategie als solides Geschäftsgebahren eine Nachhaltigkeitsperspektive einzubeziehen.

## Geschlechterdiversität

Frauen im Verwaltungsrat	Anzahl der Wertpapiere
0	0
1	2
2	8
3	18
4	8
5	6
6	0
7	0
8	0
9	0
10	0
10+	0
Nicht verfügbar	0
<b>Gesamt</b>	<b>42</b>

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 30 Jun 2024

**Grüne Einnahmen in %:** prozentualer Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen oder kohlenstoffarmen Produkten/Geschäften, klassifiziert nach dem FTSE-LCE-System

**Braune Einnahmen in (%):** prozentualer Anteil der Einnahmen aus „braunen“ Sektoren - extraktiven Sektoren, wie von S&P Trucost klassifiziert

**TCFD - Gewichtete durchschnittliche Kohlendioxid-Emissionsintensität** - Das Engagement des Portfolios in kohlenstoffintensiven Unternehmen, ausgedrückt in Tonnen CO<sub>2</sub>e/Mio. USD Umsatz. Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen werden den Portfoliogewichtungen (der aktuelle Wert der Anlage im Verhältnis zum aktuellen Portfoliowert) entsprechend umgelegt.

**TCFD - Gesamte Kohlendioxidemissionen** - Die absoluten Treibhausgasemissionen, die mit einem Portfolio verbunden sind, ausgedrückt in Tonnen CO<sub>2</sub>e. Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen werden auf der Grundlage eines Eigenkapitalansatzes auf Anleger umgelegt.

**TCFD - CO<sub>2</sub>-Bilanz** - Gesamte Kohlendioxidemissionen eines Portfolios, die nach dem Marktwert des Portfolios normalisiert und in Tonnen CO<sub>2</sub>e/investierte Mio. USD ausgedrückt werden. Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen werden auf der Grundlage eines Eigenkapitalansatzes auf Anleger umgelegt.

**TCFD - Kohlendioxid-Emissionsintensität** - Volumen der Kohlendioxidemissionen pro Mio. USD Umsatz (Kohlendioxidintensität eines Portfolios), ausgedrückt in Tonnen CO<sub>2</sub>e/Mio. USD Umsatz. Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen werden auf der Grundlage eines Eigenkapitalansatzes auf Anleger umgelegt

#### **Geschlechterdiversität**

Wir verwenden derzeit den FactSet-eigenen Datensatz „People“, um die Anzahl der Frauen im Verwaltungsrat für jedes Portfoliounternehmen des Fonds zu ermitteln.

Die Daten und Kennzahlen wurden zum Zeitpunkt dieses Berichts von den folgenden Stellen wie nachstehend erläutert erhoben und unterliegen den unten aufgeführten Hinweisen. Alle anderen Daten stammen von SSGA.

**Trucost-Abschnitte** CO<sub>2</sub>-Intensität (Direkt+Indirekt), gewichtete durchschnittliche CO<sub>2</sub>-Intensität (Direkt+Indirekt), Gesamtemissionen CO<sub>2</sub>, CO<sub>2</sub>-Fußabdruck. Trucost® ist eine eingetragene Marke von S&P Trucost Limited („Trucost“). Die Nutzung wurde im Rahmen einer Lizenz gestattet. Der ESG-Bericht wird weder von Trucost noch von mit Trucost verbundenen Unternehmen (zusammen die „Lizenzgeber“) gesponsert, verkauft, beworben oder anderweitig unterstützt. Kein Lizenzgeber gibt hinsichtlich der aus der Nutzung von Trucost-Daten mit dem Bericht zu erzielenden Ergebnisse oder hinsichtlich der Eignung von Trucost-Daten für die Zwecke, zu denen diese Daten im Zusammenhang mit dem Bericht genutzt werden, direkt oder indirekt Erklärungen, Prognosen, Zusicherungen oder Garantien ab. Im Zusammenhang mit dem Bericht ist keiner der Lizenzgeber beratend (Finanzberatung, Investmentberatung) tätig oder gibt Empfehlungen ab. Die Lizenzgeber haften gegenüber Dritten nicht für etwaige aus Fahrlässigkeit oder anderweitig entstandene Fehler in den Trucost-Daten und sind nicht verpflichtet, auf Fehler aufmerksam zu machen.

#### **FactSet-Abschnitte; Geschlechtervielfalt**

Diese Publikation kann urheberrechtlich geschützte Informationen von FactSet enthalten („FactSet-Informationen“), die ohne die ausdrückliche, vorherige schriftliche Zustimmung von FactSet nicht vervielfältigt, verwendet, verbreitet, verändert oder in irgendeiner Weise veröffentlicht werden dürfen. Die FactSet-Informationen werden „wie besehen“ bereitgestellt, und alle Zusicherungen und Gewährleistungen, ob mündlich oder schriftlich, ausdrücklich oder stillschweigend (nach allgemeinem Recht oder gesetzlich oder anderweitig), werden hiermit ausgeschlossen und abgelehnt, soweit dies gesetzlich zulässig ist. Insbesondere in Bezug auf die FactSet-Informationen lehnt FactSet jegliche stillschweigende Gewährleistung der Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck ab und übernimmt keine Garantie im Hinblick auf Richtigkeit, Vollständigkeit, Aktualität, Funktionalität und/oder Zuverlässigkeit. Die FactSet-Informationen sind nicht als Anlageberatung zu verstehen. Sämtliche Meinungen oder Behauptungen in einer Veröffentlichung mit FactSet-Informationen (und/oder die FactSet-Informationen selbst) stellen nicht die Meinungen oder Überzeugungen von FactSet, seinen Konzerngesellschaften und/oder verbundenen Unternehmen und/oder einem ihrer jeweiligen Mitarbeiter dar. FactSet haftet nicht für Schäden, die sich aus der Verwendung dieser Publikation oder der hierin enthaltenen FactSet-Informationen ergeben.