

State Street Climate Transition Euro Corporate Bond Beta Fund

State Street Global
Advisors Luxembourg
SICAV

Anlageziel des Fonds

Der Fonds strebt die Erwirtschaftung langfristigen Kapitalzuwachses durch Anlagen am Markt für auf Euro lautende festverzinsliche Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating an.

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 besteht darin, in Anleihen von Unternehmen zu investieren, die aktuell und in der Zukunft geringere Kohlenstoffemissionen aufweisen (gemessen an den Reserven fossiler Brennstoffe), in grüne Anleihen und Anleihen klimafreundlicher Emittenten sowie in Anleihen von Unternehmen, die für die physischen Risiken des Klimawandels besser gewappnet sind. Gleichzeitig werden Wertpapiere auf Basis der Beurteilung ihrer Einhaltung von ESG-Kriterien (z. B. internationale Normen in Bereichen wie Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsstandards, Korruptionsbekämpfung, umstrittene Waffen und Tabak) herausgefiltert.

Der Anlageverwalter investiert aktiv im Auftrag des Fonds mittels der „Sustainable Climate Corporate Bond Strategy“, die im Abschnitt „Anlagestrategien“ des Prospekts genauer beschrieben wird.

Die Performance des Fonds wird gegenüber jener des Bloomberg Euro Aggregate Corporate Bond Index gemessen.

Fondsinformationen

Anteilsklasse	[I Distributing] Institutionelle Investoren
Benchmark	Bloomberg EURO-Aggregate : Corporates
Struktur	Investment Company
UCITS-konform	Ja
Domizil	Luxemburg

Fondsdaten	
ISIN	LU2407950356
NAV	10,09 EUR per 28 November 2025
Währung	EUR
Fondsvolumen (NAV) (Mio.)	346,18 EUR per 28 November 2025
Auflagedatum	23 März 2022
SFDR-Fondsklassifizierung	SFDR – Artikel 8
Anlagestil	Smart Beta
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	0.25%
Verkauf	0.00%
Einmalanlage	EUR 3 000 000,00
Folgeinvestments	EUR 1 000,00
Managementgebühren	0,2%
Tatsächliche TER	0,28%
Gebühren, die an den Fonds gezahlt wurden	Kauf: k.A. Verkauf: Bis zu 2%

¹ Anhaltspunkt zum Datum dieses Factsheets, Änderungen vorbehalten

Wertentwicklung					
	Benchmark	Fonds vor Kosten (brutto)	Differenz	Fonds nach Kosten (netto)	Differenz
Annualisiert (%)					
1 Jahr	2,84	2,85	0,01	2,56	-0,28
3 Jahre	4,73	4,84	0,11	4,55	-0,19
5 Jahre	-	-	-	-	-
Seit Auflage	1,67	1,69	0,02	1,40	-0,27
Kumuliert (%)					
1 Monat	-0,24	-0,24	0,01	-0,26	-0,01
3 Monate	0,84	0,84	0,00	0,77	-0,07
1 Jahr	2,84	2,85	0,01	2,56	-0,28
3 Jahre	14,89	15,24	0,35	14,27	-0,62
5 Jahre	-	-	-	-	-
Seit Auflage	6,31	6,38	0,07	5,27	-1,04
Kalenderjahr (%)					
2025 (YTD)	3,23	3,27	0,05	3,01	-0,22
2024	4,74	4,83	0,09	4,54	-0,20
2023	8,19	8,38	0,19	8,06	-0,12
2022 (partiell)	-9,11	-9,33	-0,22	-9,54	-0,43

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.

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. Dezember 2021 war die Benchmark des Fonds der Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Corporate Bond Index.

Vor dem 30. April 2025 war der Fonds unter der Bezeichnung State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund.

Quelle: State Street Investment Management.

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 30/11/2025

Merkmale		
	Fonds	Benchmark
Anzahl der Vermögenswerte*	1 673	4 022
Durchschnittliche (optionsbereinigte) Endfälligkeitsrendite (%)	3,10	3,10
Rückzahlungsrendite (%)	3,11	3,11
Laufende Rendite (%)	2,80	2,83
Durchschnittlicher Kupon (%)	2,83	2,85
Optionsbereinigter Spread (in Basispunkten)	82,52	82,55
Effektive Duration (Jahre)	4,55	4,55
Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre)	5,20	5,18
Effektive Konvexität	0,31	0,30
Durchschnittliches Rating	BAA1	BAA1

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

Kennzahlen	3 Jahre
Standardabweichung (%)	3,48
Tracking Error (%)	0,15
Beta	1,01

Länder		
	Fonds (%)	Benchmark (%)
USA	21,49	22,03
Frankreich	18,29	19,13
Deutschland	11,98	12,99
Großbritannien	8,09	8,06
Niederlande	5,69	4,96
Spanien	5,60	5,83
Italien	4,83	5,62
Schweden	3,78	2,85
Dänemark	2,35	2,06
Belgien	2,23	2,13
Andere	15,65	14,36
Gesamt	100,00	100,00

Branchen		
	Fonds (%)	Benchmark (%)
Industrien	48,45	49,10
Finanzsektor	43,30	42,65
Versorger	8,12	8,25
Cash	0,13	-
Gesamt	100,00	100,00

Kreditrating-Positionen		
	Fonds (%)	Benchmark (%)
Aaa	0,43	0,39
Aa	7,10	6,90
A	42,42	42,44
Baa	50,04	50,28
Nicht geratet	0,00	0,00
Gesamt	100,00	100,00

Fälligkeiten		
	Fonds (%)	Benchmark (%)
0 - 1 Jahr	0,13	-
1 - 3 Jahre	30,40	30,11
3 - 5 Jahre	26,12	27,25
5 - 7 Jahre	21,29	20,18
7 - 10 Jahre	15,17	15,51
10 - 20 Jahre	6,14	6,46
> 20 Jahre	0,74	0,50

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

France

+33 (0) 1 44 45 40 48

Germany

+49 (0) 89 55878 999

Ireland

+353 (1) 776 3000

Italy

+39 02 3206 6121

Middle East & Africa

+971 2 245 9000

Netherlands

+31 (0) 20 718 1701

Switzerland

+41 (0) 44 245 7099

United Kingdom

+44 (0) 20 3395 2333

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](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.**

„Bloomberg“™ und alle Bloomberg-Indizes sind
Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance
L.P. und seinen verbundenen Unternehmen,
einschließlich Bloomberg Index Services
Limited („BISL“), dem Verwalter des Index
(zusammen „Bloomberg“), und wurden für
bestimmte Zwecke von State Street Bank and
Trust Company, durch seine Abteilung State

Street Global Advisors („SSGA“), lizenziert.
Bloomberg ist nicht mit SSGA verbunden.
Bloomberg genehmigt, befürwortet, prüft oder
empfiehlt kein Produkt von SSGA. Bloomberg
gibt keinerlei Garantien für die Aktualität,
Genauigkeit oder Vollständigkeit von Daten oder
Informationen in Bezug ein SSGA-Produkt ab.
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.

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