

# State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund

State Street Global  
Advisors Luxembourg  
SICAV

## Anlageziel des Fonds

Das Ziel des Fonds besteht darin, die Performance des weltweiten Marktes für festverzinsliche hochverzinsliche 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

Der State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund („Fonds“) ist ein Indexfonds, der die Wertentwicklung des ICE BofA Global High Yield Constrained Index („Index“) nachbildet. Dabei werden Wertpapiere auf Basis einer Beurteilung ihrer Einhaltung der ESG-Kriterien ausgefiltert, die vom Anlageverwalter festgelegt werden.

Die Anlagepolitik des Fonds besteht darin, den Anlegern eine Rendite zu bieten, welche der Wertentwicklung des Index entspricht. Dabei werden Wertpapiere auf Basis einer Beurteilung ihrer Einhaltung von ESG-Kriterien ausgefiltert, die vom Anlageverwalter festgelegt werden. Insbesondere wird auf das Portfolio des Fonds ein normenbasiertes Negativ-

Screening angewandt, um Unternehmen nach den folgenden Ausschlusskriterien auszufiltern:

- kontroverse Waffen;
- Verstöße gegen den UN Global Compact („UNGC“);
- Kraftwerkskohle;
- arktische Bohrungen;
- Öl- und Teersande;
- schwerwiegende ESG-Kontroversen;
- zivile Feuerwaffen und
- Tabak.

## Fondsinformationen

|               |  |
|---------------|--|
| Anteilsklasse | [I CHF Portfolio Hedged Distributing] Institutionelle Investoren |
| Benchmark     | ICE BofA Global High Yield Constrained Index                     |
| Struktur      | Investment Company   |
| UCITS-konform | Ja   |
| Domizil       | Luxemburg  |

| Fondsdaten                                |   |
|---|---|
| ISIN                                      | LU3030270253  |
| NAV                                       | 9,88 CHF per 29 Mai 2026  |
| Währung                                   | CHF   |
| Fondsvolumen (NAV) (Mio.)                 | 1 368,98 USD per 29 Mai 2026  |
| Auflagedatum                              | 22 Mai 2025   |
| SFDR-Fondsklassifizierung                 | SFDR – Artikel 8  |
| Anlagestil                                | Index   |
| Land/Region                               | Global  |
| Abrechnung                                | Zyklus für die Abrechnung von Rücknahmen, DD+2; Zyklus für die Abrechnung von Zeichnungen, DD+2 |
| Mitteilungsfrist                          | DD-1 14:00 Uhr MEZ  |
| Bewertung                                 | Täglich, Börsenschluss  |
| Swingfaktor <sup>1</sup>                  |   |
| Kauf                                      | 0,30%   |
| Verkauf                                   | 0,00%   |
| Einmalanlage                              | CHF 3 000 000,00  |
| Folgeinvestments                          | CHF 1 000,00  |
| Managementgebühren                        | 0,18%   |
| Tatsächliche TER                          | 0,26%   |
| Gebühren, die an den Fonds gezahlt wurden | Kauf: k.A.<br>Verkauf: Bis zu 0%  |

<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                  | 2,93      | 3,26                      | 0,33      | 2,57                      | -0,35     |
| 3 Jahre                 | -         | -                         | -         | -                         | -         |
| 5 Jahre                 | -         | -                         | -         | -                         | -         |
| Seit Auflage            | 3,23      | 3,22                      | -0,01     | 2,95                      | -0,28     |
| <b>Kumuliert (%)</b>    |           |                           |           |                           |           |
| 1 Monat                 | 0,33      | 0,40                      | 0,06      | 0,37                      | 0,04      |
| 3 Monate                | -0,19     | -0,07                     | 0,11      | -0,14                     | 0,05      |
| 1 Jahr                  | 2,93      | 3,26                      | 0,33      | 2,57                      | -0,35     |
| 3 Jahre                 | -         | -                         | -         | -                         | -         |
| 5 Jahre                 | -         | -                         | -         | -                         | -         |
| Seit Auflage            | 3,31      | 3,30                      | -0,01     | 3,02                      | -0,29     |
| <b>Kalenderjahr (%)</b> |           |                           |           |                           |           |
| 2026 (YTD)              | 0,19      | 0,37                      | 0,18      | 0,26                      | 0,07      |
| 2025 (partiell)         | 3,11      | 2,92                      | -0,19     | 2,76                      | -0,36     |

**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 Januar 2023 war der Fonds unter der Bezeichnung State Street Global High Yield Bond ESG Screened Index Fund.

Quelle: State Street Investment Management.

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 31/05/2026

| <b>Merkmale</b>   |              |                  |
|---|--------------|------------------|
|   | <b>Fonds</b> | <b>Benchmark</b> |
| Anzahl der Vermögenswerte*                                      | 2 973        | 3 306            |
| Durchschnittliche (optionsbereinigte) Endfälligkeitsrendite (%) | 6,59         | 6,70             |
| Rückzahlungsrendite (%)   | 7,01         | 7,13             |
| Laufende Rendite (%)  | 6,56         | 6,64             |
| Durchschnittlicher Kupon (%)                                    | 6,47         | 6,50             |
| Optionsbereinigter Spread (in Basispunkten)                     | 260,35       | 271,95           |
| Effektive Duration (Jahre)                                      | 2,99         | 3,08             |
| Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre)                          | 6,16         | 6,27             |
| Effektive Konvexität  | -0,20        | -0,19            |
| Durchschnittliches Rating                                       | B1           | B1               |

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

| <b>Kennzahlen</b>      | <b>3 Jahre</b> |
|------------------------|----------------|
| Standardabweichung (%) | -              |
| Tracking Error (%)     | -              |
| Beta                   | -              |

| <b>Länder</b>  |                  |                      |
|----------------|------------------|----------------------|
|                | <b>Fonds (%)</b> | <b>Benchmark (%)</b> |
| USA            | 59,38            | 56,63                |
| Großbritannien | 4,93             | 4,25                 |
| Frankreich     | 4,78             | 4,66                 |
| Kanada         | 3,66             | 3,14                 |
| Italien        | 2,68             | 2,63                 |
| Deutschland    | 2,62             | 2,59                 |
| Brasilien      | 2,30             | 2,81                 |
| Luxemburg      | 1,65             | 1,69                 |
| Japan          | 1,50             | 1,51                 |
| Türkei         | 1,31             | 1,59                 |
| Andere         | 15,19            | 18,49                |
| <b>Gesamt</b>  | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

| <b>Branchen</b> |                  |                      |
|-----------------|------------------|----------------------|
|                 | <b>Fonds (%)</b> | <b>Benchmark (%)</b> |
| Industrien      | 77,90            | 76,30                |
| Finanzsektor    | 13,56            | 13,08                |
| Versorger       | 4,03             | 4,07                 |
| Non Corporates  | 3,34             | 5,95                 |
| Cash            | 0,61             | -                    |
| Agent           | 0,52             | 0,56                 |
| Andere          | 0,04             | 0,04                 |
| <b>Gesamt</b>   | <b>99,99</b>     | <b>100,00</b>        |

| <b>Kreditrating-Positionen</b> |                  |                      |
|--------------------------------|------------------|----------------------|
|                                | <b>Fonds (%)</b> | <b>Benchmark (%)</b> |
| Aaa                            | 0,61             | -                    |
| Baa                            | 0,47             | 0,40                 |
| Unterhalb der BAA              | 88,81            | 87,86                |
| Nicht geratet                  | 10,11            | 11,74                |
| <b>Gesamt</b>                  | <b>100,00</b>    | <b>100,00</b>        |

| <b>Fälligkeiten</b> |                  |                      |
|---------------------|------------------|----------------------|
|                     | <b>Fonds (%)</b> | <b>Benchmark (%)</b> |
| 0 - 1 Jahr          | 0,89             | 0,01                 |
| 1 - 3 Jahre         | 23,39            | 23,69                |
| 3 - 5 Jahre         | 39,87            | 38,47                |
| 5 - 7 Jahre         | 22,31            | 23,19                |
| 7 - 10 Jahre        | 10,36            | 10,47                |
| 10 - 20 Jahre       | 1,72             | 1,83                 |
| > 20 Jahre          | 0,77             | 1,47                 |

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

**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](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.**

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.

© 2026 State Street Corporation.  
Alle Rechte vorbehalten.  
Fälligkeit: 20/07/2026