

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	10,32 CHF per 27 Februar 2026
Währung	CHF
Fondsvolumen (NAV) (Mio.)	1 146,25 USD per 27 Februar 2026
Aufledgedatum	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 ¹	
Kauf	0,30%
Verkauf	0,00%
Einmalanlage	CHF 3 000 000,00
Folgeinvestments	CHF 1 000,00
Managementgebühren	0,18%
Tatsächliche TER	k.A
Gebühren, die an den Fonds gezahlt wurden	Kauf: k.A Verkauf: Bis zu 0%

¹ Anhaltspunkt zum Datum dieses Factsheets, Änderungen vorbehalten

Die Wertentwicklung des Fonds ist nicht angegeben, da die Auflegung des Fonds vor weniger als 12 Monaten erfolgte.

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

Merkmale

	Fonds	Benchmark
Anzahl der Vermögenswerte*	2 877	3 231
Durchschnittliche (optionsbereinigte) Endfälligkeitsrendite (%)	6,42	6,48
Rückzahlungsrendite (%)	6,84	6,92
Laufende Rendite (%)	6,48	6,56
Durchschnittlicher Kupon (%)	6,43	6,46
Optionsbereinigter Spread (in Basispunkten)	292,44	295,41
Effektive Duration (Jahre)	2,92	2,98
Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre)	5,98	6,31
Effektive Konvexität	-0,22	-0,21
Durchschnittliches Rating	B1	B1

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

Kennzahlen	3 Jahre
Standardabweichung (%)	-
Tracking Error (%)	-
Beta	-

Länder	Fonds (%)	Benchmark (%)
USA	57,96	56,14
Frankreich	4,77	4,72
Großbritannien	4,58	4,43
Kanada	3,60	3,22
Italien	2,70	2,56
Deutschland	2,56	2,71
Brasilien	2,44	2,96
Japan	1,74	1,55
Luxemburg	1,68	1,67
Türkei	1,45	1,56
Andere	16,52	18,47
Gesamt	100,00	100,00

Branchen

	Fonds (%)	Benchmark (%)
Industrien	77,69	76,35
Finanzsektor	12,82	12,60
Versorger	4,22	4,28
Non Corporates	3,87	6,07
Cash	0,75	-
Agent	0,59	0,64
Andere	0,05	0,05
Gesamt	100,00	100,00

Kreditrating-Positionen

	Fonds (%)	Benchmark (%)
Aaa	0,75	-
Baa	1,01	0,24
Unterhalb der BAA	87,44	88,19
Nicht geratet	10,80	11,57
Gesamt	100,00	100,00

Fälligkeiten

	Fonds (%)	Benchmark (%)
0 - 1 Jahr	2,11	0,85
1 - 3 Jahre	20,35	22,00
3 - 5 Jahre	41,69	39,79
5 - 7 Jahre	23,52	23,75
7 - 10 Jahre	9,83	10,51
10 - 20 Jahre	1,62	1,58
> 20 Jahre	0,88	1,52

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](https://www.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 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.

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:17/04/2026