

# 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.

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.

### 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.

### Fondsinformationen

Anteilsklasse	[B] Institutionelle Investoren
Benchmark	Bloomberg Euro Aggregate Corporate Bond Index
Struktur	Investment Company
UCITS-konform	Ja
Domizil	Luxemburg

### 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.

**Fondsdaten**

ISIN	LU2389762191
NAV	10,58 EUR per 28 November 2025
Währung	EUR
Fondsvolumen (NAV) (Mio.)	346,18 EUR per 28 November 2025
Auflagedatum	31 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 <sup>1</sup>	
Kauf	0,25%
Verkauf	0,00%
Einmalanlage	EUR 10 000 000,00
Folgeinvestments	EUR 5 000,00
Managementgebühren	0%
Tatsächliche TER	k.A
Gebühren, die an den Fonds gezahlt wurden	Kauf: k.A Verkauf: Bis zu 2%

<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	2,84	2,85	0,01	2,78	-0,06
3 Jahre	4,73	4,85	0,11	4,78	0,04
5 Jahre	-	-	-	-	-
Seit Auflage	1,67	1,63	-0,04	1,55	-0,12
<b>Kumuliert (%)</b>					
1 Monat	-0,24	-0,23	0,01	-0,24	0,00
3 Monate	0,84	0,84	0,00	0,83	-0,02
1 Jahr	2,84	2,85	0,01	2,78	-0,06
3 Jahre	14,89	15,26	0,37	15,03	0,13
5 Jahre	-	-	-	-	-
Seit Auflage	6,27	6,11	-0,17	5,82	-0,46
<b>Kalenderjahr (%)</b>					
2025 (YTD)	3,23	3,27	0,05	3,21	-0,02
2024	4,74	4,83	0,10	4,76	0,03
2023	8,19	8,39	0,20	8,31	0,12
2022 (partiell)	-9,14	-9,58	-0,44	-9,65	-0,51

**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**

	<b>Fonds</b>	<b>Benchmark</b>
Anzahl der Vermögenswerte*	1 673	4 022
Durchschnittliche (optionsbereinigte) Endfälligkeitserträge (%)	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**

	<b>3 Jahre</b>
Standardabweichung (%)	3,48
Tracking Error (%)	0,15
Beta	1,01

**Länder**

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

**Branchen**

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

**Kreditrating-Positionen**

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

**Fälligkeiten**

	<b>Fonds (%)</b>	<b>Benchmark (%)</b>
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

**Middle East & Africa**

+971 2 245 9000

**France**

+33 (0) 144 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](http://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  
fordern 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 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, befüwortet, 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