

SSGA Luxembourg SICAV - State Street North America Screened Enhanced Equity

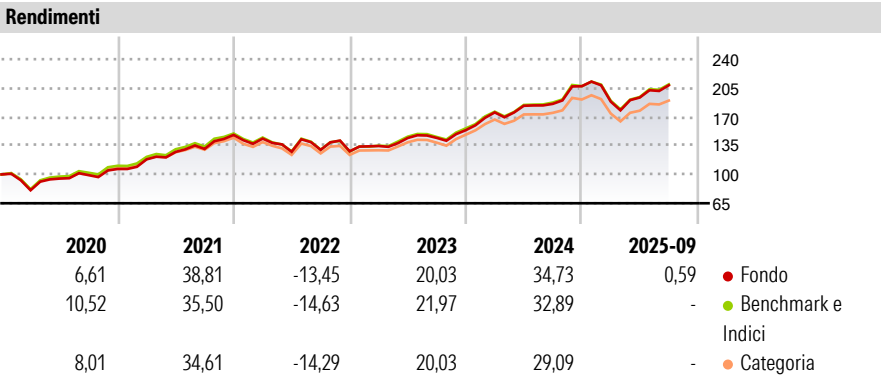
Categoria Morningstar™  
Fondo S&P Large Cap Blend

Benchmark Morningstar  
Morningstar US Large-Mid Cap NR USD  
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato  
MSCI North America NR USD

Morningstar Rating™  
Senza rating

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**  
L'obiettivo del Fondo è quello di cercare di superare il rendimento dell'Indice MSCI North America Index (dividendi netti reinvestiti) (l'"Indice"). I dati MSCI non possono essere riprodotti o utilizzati per altre finalità. MSCI non fornisce alcuna garanzia, non ha redatto né approvato la presente relazione e non ha responsabilità in proposito.



| Misure di Rischio |       |                 |       |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha          | -0,08 | 3Y Sharpe Ratio | 0,98  |
| 3Y Beta           | 1,00  | 3Y Std Dev      | 14,19 |
| 3Y R-Squared      | 99,31 | 3Y Risk         | -     |
| 3Y Info Ratio     | -0,12 | 5Y Risk         | -     |
| 3Y Tracking Error | 1,13  | 10Y Risk        | -     |

Basati su Morningstar US Large-Mid Cap NR USD (dove applicabile)

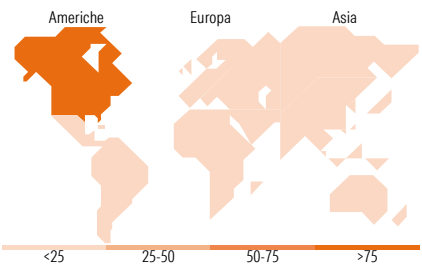
| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk   | Cat   | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2     | Q3   | Q4    |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|-------|--------|------|-------|
| 3-Mesi           | 8,33  | -1,14 | -0,49 | 2026                     | -     | -      | -    | -     |
| 6-Mesi           | 25,02 | 6,62  | 6,87  | 2025                     | -9,03 | 2,67   | 7,70 | -     |
| 1-Anno           | 12,14 | 0,95  | 1,04  | 2024                     | 14,05 | 4,61   | 1,25 | 11,54 |
| 3-Anni Ann.ti    | 16,69 | 17,10 | 15,06 | 2023                     | 5,03  | 7,22   | 0,11 | 6,47  |
| 5-Anni Ann.ti    | 15,86 | 13,79 | 12,76 | 2022                     | -3,04 | -11,12 | 1,83 | -1,37 |
| 10-Anni Ann.ti   | 12,95 | 14,23 | 12,98 |                          |       |        |      |       |

Rendimenti aggiornati al 07/10/2025

Portafoglio 30/09/2025



| Style Box Azionaria         | Mkt Cap %                         | Fondo      |
|-----------------------------|-----------------------------------|------------|
| Capitalizz. Large Mid Small | Giant                             | 42,66      |
| Value Blend Growth Stile    | Large                             | 28,33      |
|                             | Medium                            | 28,63      |
|                             | Small                             | 0,38       |
|                             | Micro                             | 0,00       |
|                             | Capitalizzazione media di mercato |            |
|                             | Ave Mkt Cap USD                   | 308.798,92 |



| Titoli principali                           |         |       |
|---|---------|-------|
| Nome  | Settore | %     |
| NVIDIA Corp                                 | ICT     | 7,62  |
| Apple Inc                                   | ICT     | 5,81  |
| Microsoft Corp                              | ICT     | 5,62  |
| Amazon.com Inc                              | ICT     | 3,38  |
| Broadcom Inc                                | ICT     | 2,65  |
| Alphabet Inc Class A                        | ICT     | 2,43  |
| Meta Platforms Inc Class A                  | ICT     | 2,32  |
| Alphabet Inc Class C                        | ICT     | 2,08  |
| Tesla Inc                                   | ICT     | 1,71  |
| E-mini S&P 500 Future Dec 25                | -       | 1,32  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 34,94 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 228   |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 0     |

| Distribuzione Settoriale %  |  | Fondo        |
|-----------------------------|--|--------------|
| <b>Ciclico</b>              |  | <b>28,38</b> |
| Materie Prime               |  | 2,37         |
| Beni di Consumo Ciclici     |  | 10,18        |
| Finanza                     |  | 13,96        |
| Immobiliare                 |  | 1,87         |
| <b>Sensibile</b>            |  | <b>56,17</b> |
| Telecomunicazioni           |  | 9,91         |
| Energia                     |  | 3,52         |
| Beni Industriali            |  | 7,62         |
| Tecnologia                  |  | 35,11        |
| <b>Difensivo</b>            |  | <b>15,45</b> |
| Beni Difensivi              |  | 4,72         |
| Salute                      |  | 8,59         |
| Servizi di Pubblica Utilità |  | 2,15         |

| Ripartizione Geografica %     |  | Fondo        |
|-------------------------------|--|--------------|
| <b>America</b>                |  | <b>99,64</b> |
| Stati Uniti                   |  | 95,12        |
| Canada                        |  | 4,49         |
| America Latina e Centrale     |  | 0,03         |
| <b>Europa</b>                 |  | <b>0,36</b>  |
| Regno Unito                   |  | 0,00         |
| Europa Occidentale - Euro     |  | 0,00         |
| Europa Occidentale - Non Euro |  | 0,36         |
| Europa dell'Est               |  | 0,00         |
| Africa                        |  | 0,00         |
| Medio Oriente                 |  | 0,00         |
| <b>Asia</b>                   |  | <b>0,00</b>  |
| Giappone                      |  | 0,00         |
| Australasia                   |  | 0,00         |
| Asia - Paesi Sviluppati       |  | 0,00         |
| Asia - Emergente              |  | 0,00         |

Anagrafica

|                        |   |                         |              |                              |        |
|------------------------|---|-------------------------|--------------|------------------------------|--------|
| Società di Gestione    | State Street Global Advisors Europe Limited | Patrimonio Classe (Mln) | 2,84 USD     | Investimento Min. Ingresso   | 50 USD |
| Telefono               | +353 1 776 3000                             | (07/10/2025)            |              | Investimento Min. Successivo | 50 USD |
| Web                    | -   | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | 0,50%  |
| Data di Partenza       | 04/05/2015                                  | Valuta del Fondo        | USD          | Spese correnti               | 0,59%  |
| Nome del Gestore       | -   | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | -      |
| Data Inizio Gestione   | -   | Inc/Acc                 | Acc          |                              |        |
| NAV (07/10/2025)       | USD 33,94                                   | ISIN                    | LU1112177693 |                              |        |
| Patrimonio Netto (Mln) | 103,48 USD                                  |                         |              |                              |        |

(30/09/2025)