

# SSGA Lux SICAV - State Street Europe ESG Screened Index Equity Fund P EUR

## Categoria Morningstar™

Azione Europa Large Cap Blend

## Benchmark Morningstar

Morningstar Developed Europe Target

Market Exposure NR EUR

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

MSCI Europe ex UNGC and CW NR EUR

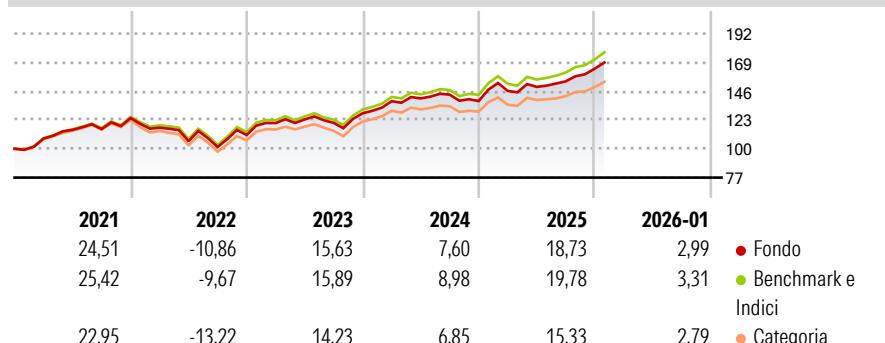
## Morningstar Rating™

★★★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

L'obiettivo del Fondo è quello di replicare il più fedelmente possibile il rendimento dell'Indice MSCI Europe Index. Il Fondo mira a mantenere il tracking error ad un valore inferiore all'1%.

### Rendimenti



### Misure di Rischio

|                   |       |                 |      |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | -0,97 | 3Y Sharpe Ratio | 1,03 |
| 3Y Beta           | 1,00  | 3Y Std Dev      | 9,04 |
| 3Y R-Squared      | 99,63 | 3Y Risk         | Med  |
| 3Y Info Ratio     | -1,86 | 5Y Risk         | Med  |
| 3Y Tracking Error | 0,56  | 10Y Risk        | -Med |

Basato su Morningstar Developed Europe Target Market Exposure NR EUR (dove applicabile)

### Rend. Cumulati %

| Periodo        | Fondo | Bmk   | Cat   |
|----------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi         | 7,16  | 7,31  | 6,96  |
| 6-Mesi         | 14,05 | 14,87 | 12,17 |
| 1-Anno         | 15,15 | 16,57 | 12,95 |
| 3-Anni Ann.ti  | 12,81 | 13,85 | 11,69 |
| 5-Anni Ann.ti  | 10,79 | 11,81 | 9,79  |
| 10-Anni Ann.ti | 9,62  | 10,36 | 8,80  |

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

### Rendimenti Trimestrali %

| Periodo | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|---------|-------|-------|-------|-------|
| 2026    | -     | -     | -     | -     |
| 2025    | 5,84  | 2,21  | 2,98  | 6,57  |
| 2024    | 7,55  | 1,60  | 2,10  | -3,55 |
| 2023    | 8,58  | 2,41  | -2,20 | 6,33  |
| 2022    | -6,19 | -9,15 | -4,36 | 9,36  |

### Portafoglio 31/12/2025



**Asset Allocation %**

- Azioni
- Obbligazioni
- Liquidità
- Altro

**Netta**

|       |
|-------|
| 99,07 |
| 0,00  |
| 0,58  |
| 0,35  |



### Mkt Cap %

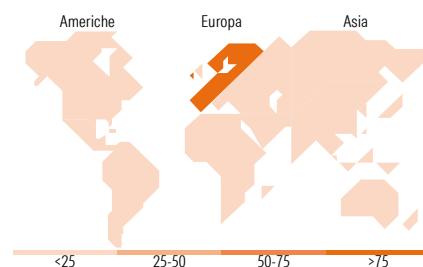
| Fondo  |
|--------|
| Giant  |
| Large  |
| Medium |
| Small  |
| Micro  |

### Capitalizzazione media di mercato

Ave Mkt Cap EUR

67.441,3

2



&lt;25 25-50 50-75 &gt;75

### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| ASML Holding NV                             | ☐       | 3,26  |
| Roche Holding AG                            | ✚       | 2,26  |
| AstraZeneca PLC                             | ✚       | 2,23  |
| HSBC Holdings PLC                           | ☒       | 2,11  |
| Novartis AG Registered Shares               | ✚       | 2,04  |
| Nestle SA                                   | ☒       | 1,99  |
| SAP SE                                      | ☒       | 1,98  |
| Shell PLC                                   | 💧       | 1,66  |
| Siemens AG                                  | ⚙       | 1,66  |
| Lvmh Moet Hennessy Louis...                 | ☒       | 1,47  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 20,64 |
| Numeri Complessivo di Titoli Azionari       |         | 386   |
| Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 0     |

### Distribuzione Settoriale %

| Fondo                       |
|-----------------------------|
| <b>Ciclico</b>              |
| Materie Prime               |
| Beni di Consumo Ciclici     |
| Finanza                     |
| Immobiliare                 |
| <b>Sensibile</b>            |
| Telecomunicazioni           |
| Energia                     |
| Beni Industriali            |
| Tecnologia                  |
| <b>Difensivo</b>            |
| Beni Difensivi              |
| Salute                      |
| Servizi di Pubblica Utilità |

| Fondo                         |
|-------------------------------|
| <b>America</b>                |
| Stati Uniti                   |
| Canada                        |
| America Latina e Centrale     |
| <b>Europa</b>                 |
| Regno Unito                   |
| Europa Occidentale - Euro     |
| Europa Occidentale - Non Euro |
| Europa dell'Est               |
| Africa                        |
| Medio Oriente                 |
| <b>Asia</b>                   |
| Giappone                      |
| Australasia                   |
| Asia - Paesi Sviluppati       |
| Asia - Emergenti              |

### Anagrafica

|                      |   |                         |              |                              |        |
|----------------------|---|-------------------------|--------------|------------------------------|--------|
| Società di Gestione  | State Street Global Advisors Europe Limited | Patrimonio Classe (Mln) | 31,47 EUR    | Investimento Min. Ingresso   | 50 EUR |
| Telefono             | +353 1 776 3000                             | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | 50 EUR |
| Web                  | -   | Valuta del Fondo        | EUR          | T.E.R.                       | 0,67%  |
| Data di Partenza     | 28/09/2015                                  | UCITS                   | Si           | Spese correnti               | 0,66%  |
| Nome del Gestore     | -   | Inc/Acc                 | Acc          | Commissione di incentivo     | -      |
| Data Inizio Gestione | 28/09/2015                                  | ISIN                    | LU1159236501 |                              |        |
| NAV (11/02/2026)     | EUR 21,84                                   |                         |              |                              |        |

# SSGA Lux SICAV - State Street Europe ESG Screened Index Equity Fund P EUR

Patrimonio Netto (Mln)

625,31 EUR

(31/12/2025)