

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

## Categoria Morningstar™

Azionari 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

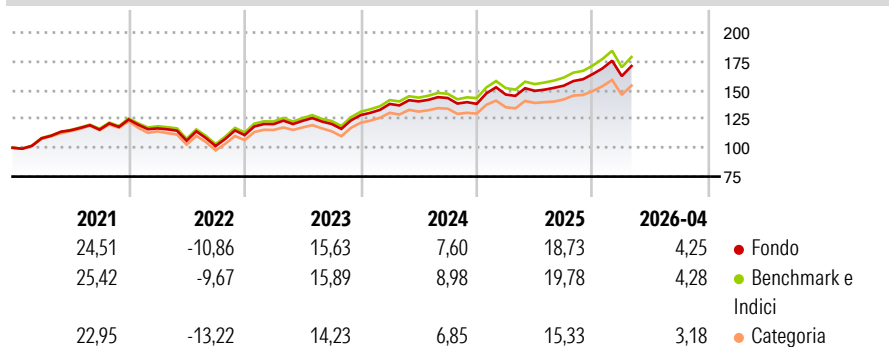
## Morningstar Rating™

★★★★

### 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          | -0,87 | 3Y Sharpe Ratio | 0,79  |
| 3Y Beta           | 1,00  | 3Y Std Dev      | 10,73 |
| 3Y R-Squared      | 99,71 | 3Y Risk         | Med   |
| 3Y Info Ratio     | -1,67 | 5Y Risk         | -Med  |
| 3Y Tracking Error | 0,58  | 10Y Risk        | -Med  |

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

### Rend. Cumulati %

|                | Fondo | Bmk   | Cat   |
|----------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi         | 0,91  | 0,77  | 0,85  |
| 6-Mesi         | 13,11 | 12,83 | 11,99 |
| 1-Anno         | 15,66 | 18,67 | 16,35 |
| 3-Anni Ann.ti  | 12,05 | 14,40 | 12,87 |
| 5-Anni Ann.ti  | 9,30  | 10,36 | 9,12  |
| 10-Anni Ann.ti | 8,52  | 8,98  | 8,03  |

Rendimenti aggiornati al 22/05/2026

### Rendimenti

|      | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2026 | -1,07 | -     | -     | -     |
| 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 30/04/2026



#### Asset Allocation %

- Azioni
- Obbligazioni
- Liquidità
- Altro

#### Netta

99,29  
0,00  
0,44  
0,27

#### Style Box Azionaria



#### Mkt Cap %

|        |       |
|--------|-------|
| Giant  | 54,07 |
| Large  | 34,84 |
| Medium | 10,99 |
| Small  | 0,10  |
| Micro  | 0,00  |

#### Capitalizzazione media di mercato

Ave Mkt Cap EUR 69.666,49



### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| ASML Holding NV                             | 🏭       | 4,20  |
| HSBC Holdings PLC                           | 🏦       | 2,38  |
| AstraZeneca PLC                             | 🏥       | 2,22  |
| Roche Holding AG Ordinary...                | 🏥       | 2,16  |
| Novartis AG Registered Shares               | 🏥       | 2,11  |
| Nestle SA                                   | 🏠       | 1,96  |
| Shell PLC                                   | 🛢️      | 1,93  |
| Siemens AG                                  | ⚙️      | 1,71  |
| TotalEnergies SE                            | 🛢️      | 1,40  |
| Banco Santander SA                          | 🏦       | 1,36  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 21,43 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 385   |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 0     |

### Distribuzione Settoriale %

|                             | Fondo        |
|-----------------------------|--------------|
| <b>Ciclico</b>              | <b>37,49</b> |
| Materie Prime               | 5,94         |
| Beni di Consumo Ciclici     | 5,94         |
| Finanza                     | 24,73        |
| Immobiliare                 | 0,87         |
| <b>Sensibile</b>            | <b>35,55</b> |
| Telecomunicazioni           | 3,70         |
| Energia                     | 5,69         |
| Beni Industriali            | 17,07        |
| Tecnologia                  | 9,09         |
| <b>Difensivo</b>            | <b>26,96</b> |
| Beni Difensivi              | 8,06         |
| Salute                      | 13,85        |
| Servizi di Pubblica Utilità | 5,05         |

### Ripartizione Geografica %

|                               | Fondo        |
|-------------------------------|--------------|
| <b>America</b>                | <b>1,90</b>  |
| Stati Uniti                   | 1,83         |
| Canada                        | 0,00         |
| America Latina e Centrale     | 0,07         |
| <b>Europa</b>                 | <b>97,54</b> |
| Regno Unito                   | 20,61        |
| Europa Occidentale - Euro     | 52,23        |
| Europa Occidentale - Non Euro | 24,66        |
| Europa dell'Est               | 0,04         |
| Africa                        | 0,00         |
| Medio Oriente                 | 0,00         |
| <b>Asia</b>                   | <b>0,56</b>  |
| Giappone                      | 0,00         |
| Australasia                   | 0,00         |
| Asia - Paesi Sviluppati       | 0,56         |
| Asia - Emergente              | 0,00         |

### Anagrafica

|                      |   |                         |              |                              |        |
|----------------------|---|-------------------------|--------------|------------------------------|--------|
| Società di Gestione  | State Street Global Advisors Europe Limited | Patrimonio Classe (Mln) | 28,40 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.                       | 0,41%  |
| 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 (22/05/2026)     | EUR 22,34                                   |                         |              |                              |        |

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotte; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

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

Patrimonio Netto (Mln)

641,91 EUR

(30/04/2026)