STATE STREET GLOBAL ADVISORS

State Street Global Advisors Luxembourg SICAV

State Street Global Aggregate Bond Index Fund

★★★ Morningstar Rating™
Per 31 Dezember 2021

Fest verzinsliche

31 Januar 2022

Anteilsklasse

[I GBP Hedged] Institutionelle Investoren

Anlageziel des Fonds

Das Ziel des Fonds besteht darin, die Performance des globalen Anleihenmarkts nachzubilden.

Anlagestrategie

Die Anlagepolitik des Fonds sieht vor, die Performance des Bloomberg Global Aggregate Bond Index (oder eines anderen Index, der vom Verwaltungsrat jeweils festgelegt wird und im Wesentlichen denselben Markt wie der Index abbildet) so genau wie möglich nachzubilden und dabei den Nachbildungsunterschied zwischen der Performance des Fonds und jener des Index so gering wie möglich zu halten.

Der Index misst die Performance des weltweiten Rentenmarkts. Der Index umfasst Staats-, regierungsnahe und Unternehmensanleihen sowie Asset-Backed-, Mortgage-Backed- und Commercial Mortgage-Backed Securities von Emittenten aus entwickelten und Schwellenmärkten. Wertpapiere müssen festverzinslich und mit „Investment Grade" bewertet sein, wie durch die Indexmethodik definiert.

In Bezug auf Unternehmensanleihen bedient sich der Anlageverwalter vor dem Aufbau des Portfolios des Fonds und fortlaufend eines negativen und normenbasierten ESG-Screenings.

Benchmark

Bloomberg Global Aggregate Hedged Index

Struktur

Investment Company

UCITS-konform

Domizil

Luxemburg

Fondsdaten

ISIN	LU0956450893
NAV	11,71 GBP per 31 Januar 2022
Währung	GBP
Fondsvolumen (NAV) (Mio.)	5 519,86 USD per 31 Januar 2022
Auflagedatum	15 September 2014
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	0.09%
Verkauf	0.01%
Einmalanlage	GBP 3 000 000,00
Folgeinvestments	GBP 1 000,00
Managementgebühren	0,18%
Tatsächliche TER	0,22%

Kosten	**Kauf**	**Verkauf**
Zahlbar an den Fonds	k.A	Bis zu 2%

[1] Anhaltspunkt zum Datum dieses Factsheets, Änderungen vorbehalten

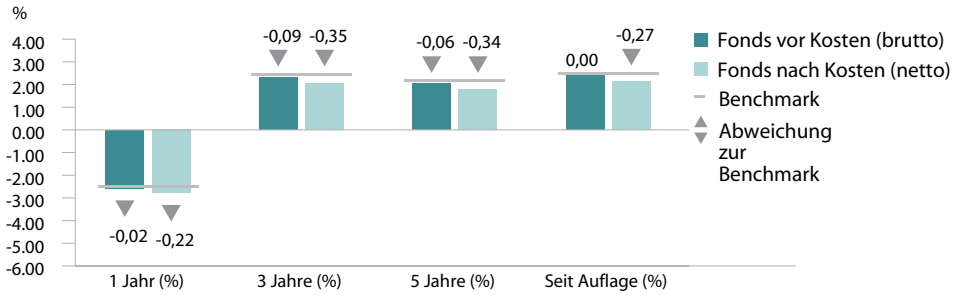
Wertentwicklung

Annualisiert	**Benchmark**	**Fonds vor Kosten (brutto)**	**Differenz**	**Fonds nach Kosten (netto)**	**Differenz**
1 Jahr (%)	-2,55	-2,58	-0,02	-2,78	-0,22
3 Jahre (%)	2,39	2,30	-0,09	2,04	-0,35
5 Jahre (%)	2,10	2,04	-0,06	1,77	-0,34
Seit Auflage (%)	2,43	2,42	0,00	2,16	-0,27
Kumuliert					
1 Monat (%)	-1,58	-1,54	0,04	-1,56	0,02
3 Monate (%)	-1,33	-1,33	0,01	-1,45	-0,12
1 Jahr (%)	-2,55	-2,58	-0,02	-2,78	-0,22
3 Jahre (%)	7,35	7,06	-0,28	6,25	-1,10
5 Jahre (%)	10,97	10,63	-0,35	9,16	-1,82
Seit Auflage (%)	19,36	19,32	-0,04	17,08	-2,28
Kalenderjahr					
2022 (seit Jahresbeginn)	-1,58	-1,54	0,04	-1,56	0,02
2021	-1,54	-1,57	-0,03	-1,78	-0,25
2020	4,96	4,73	-0,23	4,49	-0,48
2019	6,46	6,42	-0,04	6,16	-0,30
2018	0,10	0,10	0,00	-0,14	-0,24

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 Global Aggregate Bond Index.

Quelle: SSGA.
Alle Daten entsprechen dem Stand vom 31/01/2022

Annualisierte Wertentwicklung



Fondsmerkmale

	Fonds	**Benchmark**
Anzahl der Vermögenswerte*	8 541	27 892
Durchschnittliche (optionsbereinigte) Endfälligkeitsrendite (%)	1,52	1,55
Rückzahlungsrendite (%)	1,52	1,55
Laufende Rendite (%)	1,89	2,09
Durchschnittlicher Kupon (%)	2,03	2,28
Optionsbereinigter Spread (in Basispunkten)	34,27	36,71
Effektive Duration (Jahre)	7,40	7,40
Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre)	8,92	9,09
Effektive Konvexität	0,92	0,92
Durchschnittliches Rating	AA3	AA3

Kennzahlen

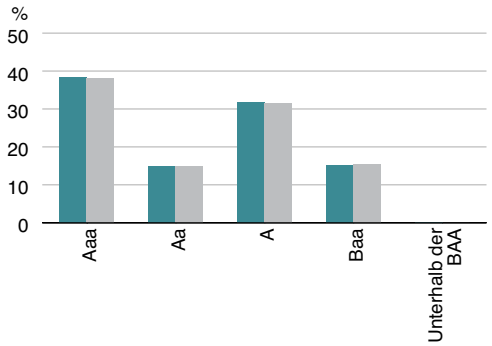
	3 Jahre
Standardabweichung (%)	3,24
Tracking Error (%)	0,11
Beta	1,01

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

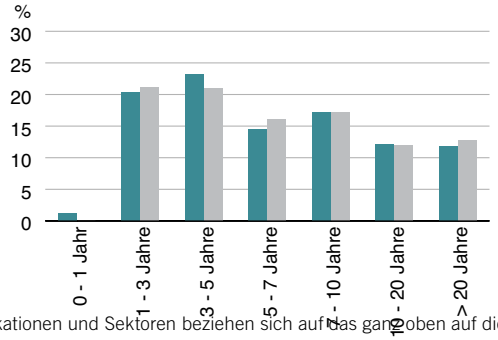
Länder	Fonds (%)	Benchmark (%)
USA	38,41	37,95
Japan	13,35	13,27
China	8,14	8,36
Frankreich	5,37	5,43
Großbritannien	4,94	5,01
Deutschland	4,87	4,85
Kanada	3,69	3,46
Italien	3,20	3,23
Spanien	2,34	2,32
Supranational	2,18	2,22
Andere	13,50	13,90
Gesamt	**100,00**	**100,00**

Branchen	Fonds (%)	Benchmark (%)
Staatsanleihen	56,57	52,99
Mortgage Backed Securities	11,99	12,26
Industrien	9,63	9,82
Finanzsektor	6,66	6,94
Agent	6,38	6,63
Non Corporates	5,72	5,92
Versorger	1,50	1,52
Andere	0,99	2,97
CMBS	0,53	0,78
Asset Backed Securities	0,03	0,16
Gesamt	**100,00**	**100,00**

Kreditrating-Positionen	Fonds (%)	Benchmark (%)
Aaa	38,27	38,21
Aa	14,82	14,77
A	31,83	31,61
Baa	15,06	15,41
Unterhalb der BAA	0,01	-
Gesamt	**100,00**	**100,00**



Fälligkeiten	Fonds (%)	Benchmark (%)
0 - 1 Jahr	1,14	0,00
1 - 3 Jahre	20,34	21,13
3 - 5 Jahre	23,10	20,95
5 - 7 Jahre	14,40	16,10
7 - 10 Jahre	17,11	17,09
10 - 20 Jahre	12,11	11,93
> 20 Jahre	11,81	12,80



Quelle: SSGA.
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 WWW.SSGA.COM ENTHALTEN SIND

Marketingmitteilung – Allgemeiner Zugang. Nur für professionelle Kunden.
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.
Für US-Anleger sind die Fonds nicht erhältlich. **Bitte lesen Sie die aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen und den Verkaufsprospekt des Fonds, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen. Die aktuelle englische Fassung des Prospekts und der KIID finden Sie unter www.ssga.com. 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 „Anlageresearch", sie sind vielmehr gemäß der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente (2014/65/EU) oder geltenden Schweizer Vorschriften als „Marketingmitteilung" klassifiziert. Dies bedeutet, dass diese Marketingmitteilung (a) nicht gemäß Rechtsvorschriften erstellt wurde, die die Unabhängigkeit von Anlageresearch fördern sollen, (b) keinem Verbot in Bezug auf den Handel vor der Verbreitung von Anlageresearch unterliegt.
Diese kollektive Kapitalanlage und ihre Vertriebsstelle sind von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht (FINMA) nach dem Kollektivanlagengesetz (KAG) und der Schweizer Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (Kollektivanlagenverordnung, KKV) zugelassen. Die kollektive Kapitalanlage wurde nach dem Recht Luxemburgs als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) strukturiert und ist als OGAW von der Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) zugelassen. Potenzielle Anleger können den aktuellen Prospekt, die Satzung, die wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) sowie den letzten Jahres- und Halbjahresbericht kostenlos von der Vertretung und Zahlstelle in der Schweiz, State Street Bank International GmbH, München, Niederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, CH-8027 Zürich, beziehen.
© 2020 Morningstar, Inc. Alle Rechte vorbehalten. Die hierin enthaltenen Informationen: (1) sind geschützte Informationen von Morningstar und/oder ihren Content-Anbietern; (2) dürfen nicht vervielfältigt oder weitergegeben werden; und (3) ihre Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität kann nicht zugesichert werden. Weder Morningstar noch seine Content-Anbieter haften für Schäden oder Verluste, die aus der Verwendung dieser Informationen resultieren.
„Bloomberg®" und alle Bloomberg-Indizes sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance 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, befürwortet, 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.
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.

© 2022 STATE STREET CORPORATION. ALLE RECHTE VORBEHALTEN.

Für weitere Informationen

Besuchen Sie unsere Website www.ssga.com oder wenden Sie sich an Ihre SSGA-Niederlassung vor Ort.

SSGA Belgien
+32 (0) 2 663 2016
SSGA Frankreich
+33 (0) 1 44 45 40 48
SSGA Deutschland
+49 (0) 89 55878 999
SSGA Irland
+353 (1) 776 3188 / +353 (1) 776 3029
SSGA Italien
+39 02 3206 6121
SSGA Middle East & Africa
+971 2 245 9000
SSGA Niederlande
+31 (0) 20 718 1701
SSGA Schweiz
+41 (0) 44 245 7099
SSGA Vereinigtes Königreich
+44 (0) 20 3395 2333