

State Street Global Screened Managed Volatility Equity Fund I (LU11115

KAG: SSGA Europe

ISIN: LU1111597263

Rücknahmepreis: 21,61 EUR

Stand: 05.06.2025

Auflagedatum	01.03.16
Ausgabeaufschlag	-
Konditionsdetails auf www.easybank.at	
Fondsvolumen	206.22 Mio.
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	weltweit
Fondstyp	Branchenmix
Fondsmanager	n.a
Kapitalanlagegesellschaft	
SSGA Europe	
78 Sir John Rogersons Quay	
D02 HD32 Dublin	
Irland	
https://www.ssga.com	



Wertentwicklung*		1J	3J p.a.	5J p.a.
Performance	vor AGA	+9,78%	+4,36%	-
Performance	nach max. AGA	+9,78%	+4,36%	-
Kennzahlen*		1J	3J	5J
Sharpe Ratio		0,75	0,23	-
Volatilität		+10,38%	+10,42%	-

* Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung zu.

Fondsstrategie

Das Ziel des Fonds besteht darin, langfristig Renditen mit einer geringeren Volatilität als jener der weltweiten Aktienmärkte und eine vergleichbare Performance zu generieren. Die Anlagepolitik des Fonds besteht darin, Renditen zu generieren, die eine geringere Volatilität als die Performance des MSCI World Index (Net) (oder eines anderen Index, der vom Verwaltungsrat jeweils festgelegt wird und im Wesentlichen denselben Markt wie der Index abbildet) aufweisen, jedoch langfristig mit dem Index vergleichbar sind.

Die Anlagepolitik sieht auch vor, dass Wertpapiere auf der Grundlage einer Beurteilung ihrer Einhaltung bestimmter ESG-Kriterien, wie im Prospekt näher beschrieben, herausgefiltert werden. Der Anlageverwalter bzw. der Unterverwalter investiert im Auftrag des Fonds aktiv. Er tätigt die Anlagen mittels der Managed Volatility-Aktienstrategie, die im Abschnitt "Anlagestrategien" des Prospekts genauer beschrieben wird, und bedient sich darüber hinaus vor dem Aufbau des Portfolios des Fonds und fortlaufend eines negativen und normenbasierten ESG-Screenings, wie im Unterabschnitt "ESG-Screening" des Abschnitts "ESG-Anlagen" des Prospekts näher beschrieben. Die Wertpapiere im Portfolio werden in erster Linie aus den im Index enthaltenen Wertpapieren ausgewählt. Nicht im Index enthaltene Wertpapiere können im Portfolio gehalten werden. Das Portfolio umfasst definierte Risikoparameter, die Grenzwerte für die Gewichtung einzelner Länder, Sektoren und Wertpapiere auf absoluter Basis sowie im Verhältnis zum jeweiligen Index umfassen.

Kommentar:

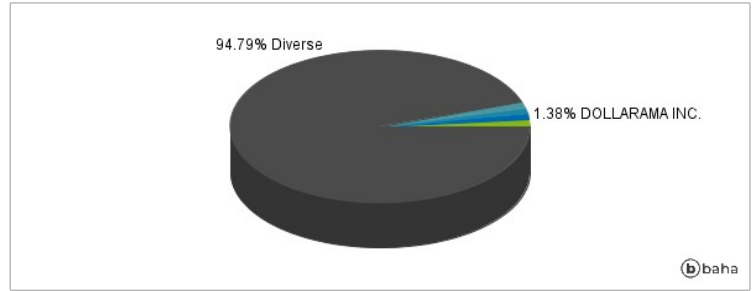
Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Der State Street Global Screened Managed Volatility Equity Fund I strebt als Anlageziel die Nachbildung des MSCI World Index an. Aufgrund der Zusammensetzung des Fonds oder der verwendeten Managementtechniken weist der Fonds eine erhöhte Volatilität auf, d.h. die Anteilswerte sind auch innerhalb kurzer Zeiträume großen Schwankungen nach oben und nach unten ausgesetzt, wobei auch Kapitalverluste nicht ausgeschlossen werden können. Die Fondsbestimmungen des State Street Global Screened Managed Volatility Equity Fund I wurden durch die FMA bewilligt. Der State Street Global Screened Managed Volatility Equity Fund I kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: by an EU Member State, its local authorities, by a member state of the OECD or public international bodies of which one or more EU Member States are members.

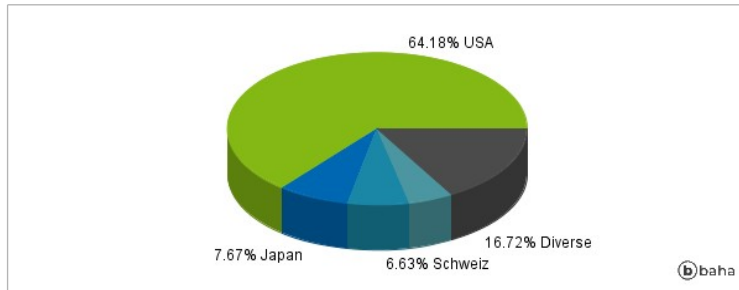
Anlagearten



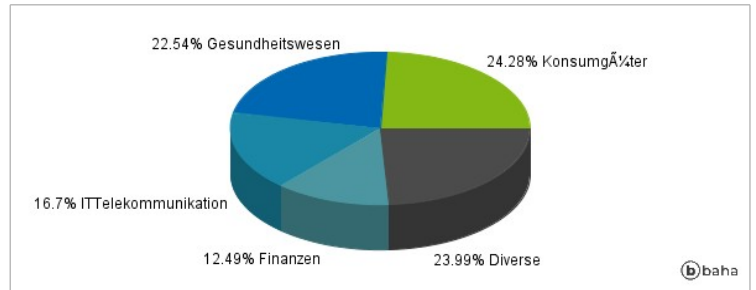
Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 06/2025

Erstellt: 07.06.2025 16:52