

Finalidad

Este documento le proporciona información fundamental que debe conocer sobre este producto de inversión. No se trata de material comercial. Es una información exigida por ley para ayudarle a comprender la naturaleza, los riesgos, los costes y los beneficios y pérdidas potenciales de este producto y para ayudarle a compararlo con otros productos. Los términos que no se definen en el presente documento tienen el significado atribuido en el Folleto.

Producto

State Street Europe Small Cap Screened Equity Fund ("Fondo")

un subfondo de State Street Global Advisors Luxembourg SICAV

Clase de acciones: P (ISIN LU1112178824)

State Street Europe Small Cap Screened Equity Fund está autorizado en Luxemburgo y está regulado por Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF).

Este Fondo está gestionado por State Street Global Advisors Europe Limited (el «Gestor del Fondo»), que está autorizado en Irlanda y supervisado por Central Bank of Ireland. Para obtener más información sobre este producto, consulte www.ssga.com

Datos exactos a: 18 de febrero de 2026

¿Qué es este producto?

Tipo

Este Fondo es una sociedad anónima de tipo abierto (société anonyme) con capital variable (société d'investissement à capital variable o SICAV) constituida en Luxemburgo el 22 de septiembre de 2008 con el número de registro B141.816 y autorizada por la CSSF como OICVM.

Plazo

La Sociedad es una sociedad anónima de capital variable constituida por un periodo de tiempo indefinido. Sin embargo, podrá disolverse en cualquier momento mediante una resolución aprobada en una junta general de Accionistas y adoptada de conformidad con la legislación aplicable.

Este Fondo no tiene fecha de vencimiento. Sin embargo, podrá cerrarse y liquidarse por decisión del Consejo de Administración si se cumplen las condiciones específicas establecidas en el Folleto.

Objetivos

Objetivo de inversión El objetivo del Fondo es proporcionar un rendimiento superior a la rentabilidad de los mercados europeos de renta variable de pequeña capitalización.

Políticas de inversión La política de inversión del Fondo consiste en superar la rentabilidad del MSCI Europe Small Cap Index (o de cualquier otro índice determinado por los Administradores cada cierto tiempo para reproducir básicamente el mismo mercado que el Índice), a medio y largo plazo.

El Fondo promueve características medioambientales o sociales de conformidad con el artículo 8 del SFDR. Estas características medioambientales y sociales se detallan en el Anexo SFDR del Suplemento del Fondo.

La Gestora de Inversiones aplica un mecanismo de selección negativa y basada en normas al Fondo para excluir valores en función de la evaluación de su cumplimiento de los criterios ESG, incluidos valores de empresas identificadas como no conformes con los Principios del PMNU (relacionados con la protección del medioambiente, los derechos humanos, los derechos laborales y la lucha contra la corrupción), y valores de empresas asociadas a controversias ESG graves, armas controvertidas, armas de fuego civiles, tabaco, carbón térmico, exploración de petróleo y gas en el Ártico, y extracción de arenas bituminosas. Al aplicar el mecanismo de selección negativa y basada en normas pertinente, la Gestora de Inversiones considera que las inversiones sostenibles del Fondo no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social.

La Gestora de Inversiones, en nombre del Fondo, invertirá activamente mediante la estrategia Quantitative Equity de renta variable cuantitativa, tal como se describe más detalladamente en el apartado «Estrategias de inversión» del Folleto. Asimismo, también emplea un mecanismo de selección negativa basada en normas y criterios ESG, antes de construir la cartera del Fondo y de forma continua, tal como se describe más detalladamente en el subapartado «Selección basada en ESG» del apartado «Inversión basada en ESG» del Folleto.

Los valores de la cartera se seleccionan principalmente a través de valores incluidos en el índice. El Fondo podrá invertir en valores u obtener exposición a aquellos que estén registrados o que se negocien en mercados distintos a los incluidos en el índice. La estrategia de

inversión utiliza parámetros definidos de riesgo, lo que significa que estará limitada la ponderación del fondo por países, sectores y valores relativos al índice respectivo. Es probable que esta estrategia limite la medida en la que el Fondo puede superar la rentabilidad del MSCI Europe Small Cap Index.

Para lograr su objetivo de inversión, el Fondo invertirá únicamente en:

- Renta variable y títulos relacionados con la renta variable;
- Otros fondos;
- Activos líquidos; y
- Derivados para una gestión eficaz de la cartera y con fines de inversión, limitados a permutas financieras, opciones, futuros y contratos de divisas a plazo.

El Fondo podrá prestar hasta el 40% de los títulos que posee.

Las Acciones de la Clase en EUR se emiten en euros.

El Fondo puede no ser adecuado para inversores que prevean retirar su dinero en un plazo de cinco años.

Los Accionistas podrán reembolsar las acciones cualquier día hábil en Luxemburgo, el Reino Unido e Irlanda (excepto los días en que los mercados financieros correspondientes estén cerrados a las operaciones, y/o el día anterior a dicho día, siempre que se publique una lista para el Fondo en www.ssga.com, sobre los días en que estarán cerrados los mercados); y cualquier otro día a discreción de los Consejeros (actuando razonablemente), siempre que se notifique por adelantado a los Accionistas sobre dichos días.

Todos los ingresos obtenidos por el Fondo se retendrán y servirán para incrementar el valor de las acciones.

Fuente del Índice: Los fondos o valores a los que se hace referencia en el presente documento no están patrocinados, refrendados ni promovidos por MSCI, y MSCI no asume ninguna responsabilidad con respecto a dichos fondos o valores ni a ningún índice en el que se basen dichos fondos o valores. El Folleto incluye una descripción más detallada de la relación limitada que mantiene MSCI con State Street Investment Management y cualquier fondo relacionado, así como exenciones de responsabilidad adicionales que se aplican a los índices MSCI. Los índices MSCI son propiedad exclusiva de MSCI y no pueden reproducirse, extraerse ni utilizarse para ningún otro fin sin el consentimiento de MSCI. Los índices MSCI se proporcionan sin garantías de ningún tipo. Consulte el Folleto para ver la exención de responsabilidad completa del índice.

Inversor minorista al que va dirigido

Este Fondo se dirige a inversores que tienen previsto mantener su inversión durante al menos cinco años y están dispuestos a asumir un nivel medio o alto de riesgo de pérdida del capital inicialmente invertido para obtener una rentabilidad potencial superior. Está diseñado para formar parte de una cartera de inversiones.

Información práctica

Entidad depositaria El depositario del Fondo es State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch.

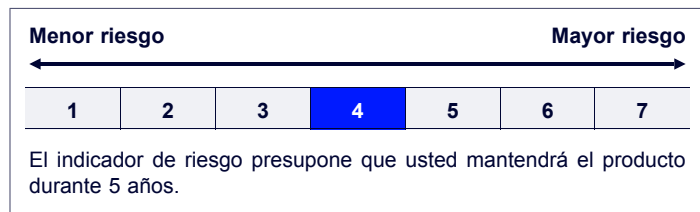
Información adicional Puede solicitar gratuitamente a www.ssga.com una copia del Folleto y de los informes financieros anual y semestral

más recientes en inglés, así como del último valor liquidativo por Acción

o escribir al Gestor del Fondo, State Street Global Advisors Europe Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublín 2, Irlanda.

¿Qué riesgos corro y qué podría obtener a cambio?

Riesgos



La categoría de riesgo anterior muestra la probabilidad de que el fondo pierda dinero debido a los movimientos en los mercados o porque no podamos pagarle. La categoría de riesgo del Fondo indicada no está garantizada y puede cambiar con el tiempo.

Escenarios de rentabilidad

Las cifras presentadas incluyen todos los costes del Fondo propiamente dicho, excepto los costes que puede que deba pagar a su asesor, distribuidor u otro intermediario. Las cifras no tienen en cuenta su situación fiscal personal, que también puede afectar a su rentabilidad.

Lo que obtenga de este producto dependerá de la evolución futura del mercado, la cual es incierta y no puede predecirse con exactitud.

Los escenarios desfavorable, moderado y favorable que se muestran son ilustraciones basadas en la rentabilidad más baja, media y más alta del producto durante los últimos 10 años. Los mercados podrían evolucionar de manera muy distinta en el futuro.

El escenario de tensión muestra lo que usted podría recibir en circunstancias extremas de los mercados.

Desfavorable: este tipo de escenario se produjo para una inversión entre octubre de 2015 y octubre de 2020.

Moderado: este tipo de escenario se produjo para una inversión entre noviembre de 2018 y noviembre de 2023.

Favorable: este tipo de escenario se produjo para una inversión entre marzo de 2020 y marzo de 2025.

Período de mantenimiento recomendado		5 años	
Ejemplo de inversión		10.000 EUR	
Escenarios		En caso de salida después de 1 año	En caso de salida después de 5 años (período de mantenimiento recomendado)
Mínimo	No hay un rendimiento mínimo garantizado. Podría perder parte o la totalidad de su inversión.		
Tensión	Lo que podría recibir tras deducir los costes. Rendimiento medio cada año	4.040 EUR -59,6%	3.560 EUR -18,7%
Desfavorable	Lo que podría recibir tras deducir los costes. Rendimiento medio cada año	7.920 EUR -20,8%	9.830 EUR -0,3%
Moderado	Lo que podría recibir tras deducir los costes. Rendimiento medio cada año	10.690 EUR 6,9%	13.880 EUR 6,8%
Favorable	Lo que podría recibir tras deducir los costes. Rendimiento medio cada año	15.750 EUR 57,5%	19.170 EUR 13,9%

¿Qué pasa si Gestor de Fondo no puede pagar?

El Gestor es responsable de la administración y gestión de la Sociedad, y normalmente no mantiene activos de la Sociedad (los activos que puede mantener un depositario se mantienen, de conformidad con la normativa aplicable, con un depositario en su red de custodia). El Gestor, en calidad de productor, no tiene obligación de pagar, ya que el diseño del producto no contempla la realización de dicho pago. Sin embargo, los inversores pueden sufrir pérdidas si la Sociedad o el depositario no pueden pagar.

¿Cuáles son los costes?

La persona que le asesore sobre este producto o se lo venda puede cobrarle otros costes. En tal caso, esa persona le facilitará información acerca de estos costes y de la incidencia que tienen en su inversión.

Costes a lo largo del tiempo

Los cuadros muestran los importes que se deducen de su inversión para cubrir diferentes tipos de costes. Estos importes dependen de cuánto invierte y de cuánto tiempo mantiene el Fondo. Los importes indicados aquí ilustran ejemplos basados en la inversión de una determinada cuantía teniendo en cuenta diferentes períodos de mantenimiento.

Hemos partido de los siguientes supuestos:

- El primer año recuperaría usted el importe invertido (rendimiento anual del 0%). En relación con los demás períodos de mantenimiento, hemos supuesto que el producto evoluciona tal como muestra el escenario moderado.
- se invierten 10.000 EUR.

Ejemplo de inversión 10.000 EUR	En caso de salida después de 1 año	En caso de salida después de 5 años (período de mantenimiento recomendado)
Costes totales	200 EUR	1.474 EUR
Incidencia anual de los costes*	2,0%	2,2% cada año

(*) Refleja la medida en que los costes reducen su rendimiento cada año a lo largo del período de mantenimiento. Por ejemplo, muestra que, en caso de salida al término del período de mantenimiento recomendado, el rendimiento medio que se prevé que obtendrá cada año será del 9,0% antes de deducir los costes y del 6,8% después de deducir los costes.

Composición de los costes

Costes únicos de entrada o salida		Incidencia anual de los costes en caso de salida después de 1 año
Costes de entrada	0,00% La incidencia de los costes que usted paga al realizar esta inversión. Se trata de la cantidad máxima que se le cobrará y podría pagar menos. El efecto de los costes ya está incluido en el precio. Se incluyen los costes de distribución de su producto.	0 EUR
Costes de salida	0,00% El efecto de los costes en caso de salida al vencimiento.	0 EUR
Costes corrientes detraídos cada año		Incidencia anual de los costes en caso de salida después de 1 año
Comisiones de gestión y otros costes administrativos o de funcionamiento	1,64% del valor de su inversión al año. Se basa en una combinación de los costes estimados y reales.	164 EUR
Costes de operación	0,36% El efecto de los costes en que incurrimos al comprar y vender las inversiones subyacentes del producto.	36 EUR
Costes accesorios detraídos en condiciones específicas		Incidencia anual de los costes en caso de salida después de 1 año
Comisiones de rendimiento	No se aplica ninguna comisión de rendimiento a este Fondo.	0 EUR

¿Cuánto tiempo debo mantener la inversión, y puedo retirar dinero de manera anticipada?

Período de mantenimiento recomendado: 5 años

Este Fondo está diseñado para inversiones a largo plazo; debe estar preparado para mantener su inversión durante al menos 5 años. Sin embargo, podrá reembolsar su inversión sin penalización en cualquier momento durante este periodo, o mantener la inversión durante más tiempo.

Es posible realizar reembolsos en cualquier día hábil y se seguirá un calendario de pagos conforme a lo dispuesto en el Suplemento y/o el Folleto del Fondo. El precio del día, que refleja el valor real del Fondo, se fija todos los días tras el punto de valoración, y se publica en nuestra página web www.ssga.com.

¿Cómo puedo reclamar?

Si tiene una reclamación sobre el Fondo o el Gestor, puede encontrar la política de gestión de reclamaciones del Gestor y más detalles sobre cómo presentar una reclamación en la sección «Contacto» del sitio web: www.ssga.com.

Otros datos de interés

Coste, rentabilidad y riesgo Los cálculos de costes, rendimiento y riesgo incluidos en este documento de datos fundamentales siguen la metodología prescrita por las normas de la UE. Tenga en cuenta que los escenarios de rentabilidad calculados anteriormente se derivan exclusivamente de la rentabilidad histórica del precio de las acciones del Fondo y que la rentabilidad histórica no es indicativa de la rentabilidad futura. Por lo tanto, su inversión puede estar en riesgo y es posible que no obtenga la rentabilidad ilustrada.

Los inversores no deben basar sus decisiones de inversión únicamente en los escenarios mostrados.

Escenarios de rentabilidad Puede solicitar los escenarios de rentabilidad anteriores que se actualizan mensualmente enviando un correo electrónico a Fund_data_services@ssga.com.

Rentabilidad histórica Puede descargar la rentabilidad histórica de los últimos 10 años en nuestro sitio web en www.ssga.com.