

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 ESG Screened Equity Fund ("Fondo")

un subfondo de State Street Global Advisors Luxembourg SICAV

Clase de acciones: P Distributing (ISIN LU1648466958)

State Street Europe Small Cap ESG 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: 27 de octubre de 2023

¿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).

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

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 hacer un seguimiento básicamente del mismo mercado que el Índice) a medio y largo plazo.

La política de inversión también implicará la exclusión de ciertos valores en función de su adhesión a los criterios ESG, es decir, a la legislación internacional en materia de protección del medioambiente, los derechos humanos, las normas de trabajo, la lucha contra la corrupción y las armas controvertidas.

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 de acuerdo con la legislación y los 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 del Fondo 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.

Los ingresos obtenidos por el Fondo serán abonados a los accionistas en función de las acciones.

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.

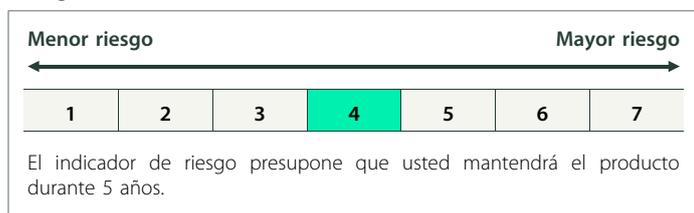
Información práctica

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.

Hemos clasificado este producto en la clase de riesgo 4 en una escala de 7, en la que un riesgo medio.

Esta evaluación califica la posibilidad de sufrir pérdidas en rentabilidades futuras como un nivel medio, y la probabilidad de que una mala coyuntura

de mercado influya en la capacidad de State Street Global Advisors Europe Limited de pagarle como posible.

Tenga presente el riesgo de cambio. Usted podría recibir pagos en una moneda diferente, por lo que el rendimiento de su inversión se verá afectado

por el tipo de cambio entre las dos monedas. Este riesgo no se tiene en cuenta en el indicador indicado anteriormente.

Además de los riesgos incluidos en el indicador de riesgo, otros riesgos pueden afectar al rendimiento del fondo. Consulte el Folleto del Fondo, disponible de forma gratuita en www.ssga.com.

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 predicirse 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 diciembre de 2021 y julio de 2023.

Moderado: este tipo de escenario se produjo para una inversión entre enero de 2014 y enero de 2019.

Favorable: este tipo de escenario se produjo para una inversión entre junio de 2016 y junio de 2021.

| 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 | 1.500 EUR -85,0% | 1.500 EUR -31,6% |
| Desfavorable | Lo que podría recibir tras deducir los costes. Rendimiento medio cada año | 7.760 EUR -22,4% | 8.490 EUR -3,2% |
| Moderado | Lo que podría recibir tras deducir los costes. Rendimiento medio cada año | 10.120 EUR 1,2% | 12.810 EUR 5,1% |
| Favorable | Lo que podría recibir tras deducir los costes. Rendimiento medio cada año | 15.440 EUR 54,4% | 16.250 EUR 10,2% |

¿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 detraen 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 | 413 EUR | 1.717 EUR |
| Incidencia anual de los costes* | 4,1% | 2,7% 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 7,8% antes de deducir los costes y del 5,1% 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 | 2,00% El efecto de los costes en caso de salida al vencimiento. | 200 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% La incidencia de los costes que asumimos cada año para gestionar sus inversiones. Esto incluirá los costes de suscribir préstamos para invertir, pero no los ingresos o beneficios de capital de hacerlo, los costes corrientes de funcionamiento de la sociedad, pero no los ingresos derivados de hacerlo, y los costes corrientes de cualquier inversión subyacente en fondos en la cartera de la Sociedad. | 164 EUR |
| Costes de operación | 0,45% El efecto de los costes en que incurrimos al comprar y vender las inversiones subyacentes del producto. | 45 EUR |
| Costes accesorios detraídos en condiciones específicas | | Incidencia anual de los costes en caso de salida después de 1 año |
| Comisiones de rendimiento | 0,00% El importe real variará en función de lo buenos que sean los resultados de su inversión. La estimación de los costes agregados anterior incluye la media de los últimos 5 años. | 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. Los reembolsos son posibles todos los días laborables; el pago tardará 2 días hábiles en realizarse.

El precio del día, que refleja el valor real del Fondo, se fija cada día a las 12:00 horas y se publica en nuestro sitio 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 5 años en nuestro sitio web en www.ssga.com.