

Detta faktablad riktar sig till investerare och innehåller basfakta om denna fond. Faktabladet är inte reklammaterial. Det är information som krävs enligt lag för att hjälpa dig att förstå vad en investering i fonden innebär och riskerna med denna. Du rekommenderas att läsa faktabladet så att du kan fatta ett välgrundat investeringsbeslut. Termer som inte definieras här ska ha samma definition som i informationsbroschyren.

# State Street Europe ESG Screened Managed Volatility Equity Fund ("Fonden"), som ingår i State Street Global Advisors Luxembourg SICAV. Fonden är förvald av State Street Global Advisors Funds Management Limited.

**Andelsklass: P Shares (ISIN LU0456116986)**

## Mål och placeringsinriktning

**Investeringsmål** Fondens mål är att generera lägre volatilitetsresultat än, och en jämförbar utveckling med, europeiska aktiemarknader på lång sikt.

**Placeringsinriktning** Fondens placeringsinriktning är att generera en avkastning som uppvisar lägre volatilitet än resultatet för MSCI Europe Index (eller något annat index som bestäms av styrelsen från tid till annan för att i huvudsak följa samma marknad som indexet), medan den är jämförbar med indexet på lång sikt.

Placeringsinriktningen kommer även omfatta en screening av värdepapper som grundar sig på en bedömning av deras efterlevnad av ESG-kriterier (dvs. internationella normer för miljöskydd, mänskliga rättigheter, arbetsnormer, antikorrupktion och kontroversiella vapen).

Investeringsförvaltaren kommer för fondens räkning investera aktivt med hjälp av en förvald volatilitetsaktiestrategi, enligt beskrivningen i avsnittet om "investeringsstrategier" i prospektet. Även en negativ och normbaserad ESG-screening tillämpas, såväl innan fondens portfölj sätts samman som fortlöpande därefter. Detta beskrivs ytterligare i delavsnittet om "ESG-screening" i avsnittet om "ESG-investering" i prospektet.

Värdepappren i portföljen väljs huvudsakligen ut från värdepappren i indexet. Portföljen kan innehålla värdepapper som inte ingår i indexet. Portföljen införlivar definierade riskparametrar som omfattar absoluta gränser för lands-, sektors- och värdepappersviktningar i förhållande till respektive index.

För att uppnå sitt investeringsmål kommer denna fond endast att investera i:

- Aktier och aktierelaterade värdepapper
- Andra fonder
- Likvida medel, samt
- Derivat för effektiv portföljförvaltning och investerings syften, vilka begränsas till swappar, optioner, terminer och valutaterminkontrakt.

Fonden kan låna ut upp till 40% av de värdepapper som den innehar.

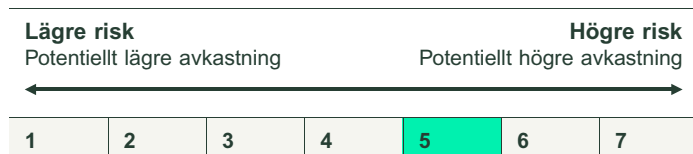
Fondens andelar utfärdas i euro.

Andelsägare kan lösa in andelar på alla affärsdagar i Luxemburg och Storbritannien (förutom dagar då relevanta finansmarknader är stängda för affärsverksamhet och/eller dagen före en sådan dag, förutsatt att en förteckning över sådana stängda marknadsdagar publiceras för fonden på [www.ssga.com](http://www.ssga.com)) och alla andra dagar efter styrelsens godkännande (utifrån vad som är rimligt) förutsatt att andelsägarna meddelas i förväg om sådana dagar.

Alla Fondens intäkter kommer att behållas och reflekteras i ett ökat värde på andelarna.

Se Fondens Informationsbroschyr för ytterligare information.

## Risk/avkastningsprofil



**Riskfriskrivningsklausul** Den ovan angivna riskkategorin är inte ett mått på kapitalförluster eller kapitalvinster utan på hur pass betydande de historiska uppgångarna och nedgångarna i fondens avkastning varit.

Till exempel kommer en fond vars avkastning har haft betydande uppgångar och nedgångar att tillhöra en högre riskkategori, medan en fond vars avkastning haft mindre betydande uppgångar och nedgångar kommer att tillhöra en lägre riskkategori.

Den lägsta kategorin (d.v.s. kategori 1) innebär inte att fonden utgör en riskfri investering.

Eftersom fondens riskkategori beräknats med hjälp av historiska data är den inte nödvändigtvis en pålitlig indikator för fondens framtida riskprofil.

Den riskkategori som visas för fonden är inte garanterad och kan komma att förändras i framtiden.

**Varför tillhör fonden denna kategori?** Denna fond tillhör riskkategori 5 eftersom dess avkastning historiskt sett har varit föremål för medelstora uppgångar och nedgångar.

Nedanstående risker är väsentliga risker som är relevanta för fonden men som inte fångas upp av riskkategorin på ett adekvat sätt.

**Valutasäkringsrisk:** Säkringar utsätts ibland för ofullständig matchning mellan säkringstransaktionen och den risk som ska säkras. Det finns inga garantier för att fondens säkringstransaktioner kommer att ge effekt. Då syftet med valutasäkring är att försöka minska eller eliminera förluster som uppstår vid valutakursförändringar, kan även vinster komma att minska eller elimineras om valutorna som fondens tillgångar är noterade i stärks.

**Modelleringsrisk:** Placeringsförvaltaren använder kvantitativa modeller i sin strävan att förbättra avkastningen och hantera riskerna. Eventuella brister, fel eller begränsningar i dessa modeller eller i deras programmering kan komma att begränsa fördelarna med fondens användning av modellerna eller leda till felaktiga utdata eller investeringsresultat som avviker från eller strider mot dem som förväntas eller önskas av placeringsförvaltaren. Sådana brister, fel eller begränsningar kommer eventuellt aldrig att identifieras, eller att identifieras först efter att en fond har drabbats av en förlust (eller minskat resultat). Det finns dessutom inga garantier för att modellerna kommer att fungera som förväntat under alla marknadsförhållanden.

**Urvalsrisk:** Det finns risk för att den urvalsansvariga begår misstag, t.ex. i form av felaktig bedömning av urvalskriterierna och/eller genom att inkludera/exkludera korrekta beståndsdelar vid urvalsprocessen eller genom att avbryta sina urvalstjänster. Under sådana omständigheter kan företaget byta sin urvalsansvariga, men det finns ingen garanti för att ett tillhandahålllet ersättningsurval kommer att ge en urvalsprocess som liknar den avsedda eller för att någon urvalsprocess alls kommer att bli tillgänglig.

**Värdepappersutlåningsrisk:** Om fonden tillämpar utlåning av värdepapper, föreligger en risk för att låntagaren åsidosätter sina skyldigheter att återlämna värdepapper som motsvarar de utlånade värdepappren. På detta sätt exponeras fonden för motpartsrisk. I sådana fall kan fonden också uppleva fördröjning vid återlämnandet av värdepapper och drabbas av kapitalförlust. Fonden kan även förlora pengar om värdet sjunker på säkerheter som innehas gentemot de utlånade värdepappren.

**Andelsklassrisk:** Ingen uppdelning görs mellan fondklassernas skulder. Medan placeringsförvaltaren eftersträvar att vinster/förluster och kostnader för de relevanta derivatinstrument som involveras vid någon valutasäkringsstrategi endast ska ackumuleras för den klass som de avser, kan transaktionerna komma att medföra skulder för andra klasser.

Se fondens informationsbroschyr för fullständig information om de risker som förknippas med denna fond.

### Avgifter

De avgifter som du betalar används till att betala fondens driftskostnader, inklusive kostnaderna för att marknadsföra och distribuera fondandelar. Dessa avgifter minskar investeringens potentiella tillväxt.

#### Engångsavgifter som debiteras före eller efter investeringstillfället

|                   |       |
|-------------------|-------|
| Insättningsavgift | 0.00% |
| Uttagsavgift      | 2.00% |

Ovanstående är det som maximalt kan tas ut av dina pengar innan de investeras och innan behållningen betalas ut.

#### Avgifter som tagits ur fonden under året

|              |       |
|--------------|-------|
| Årlig avgift | 1.04% |
|--------------|-------|

#### Avgifter som tagits ur fonden under särskilda omständigheter

|                           |       |
|---------------------------|-------|
| Prestationsbaserad avgift | ingen |
|---------------------------|-------|

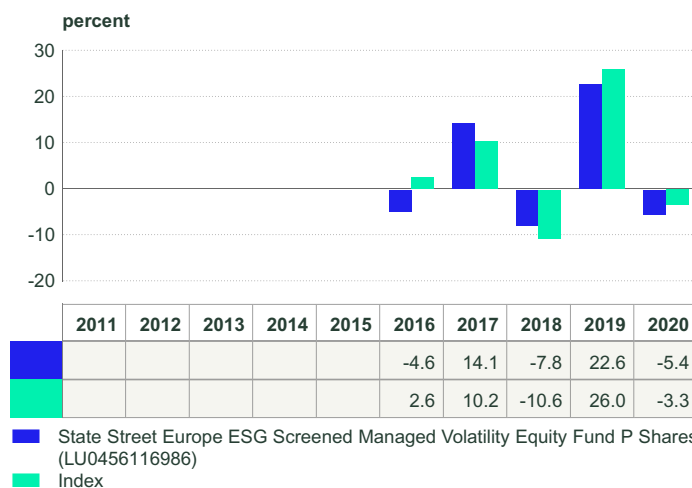
De insättnings- och uttagsavgifter som anges är maximibelopp. I vissa fall kan du få betala mindre. Mer information om detta kan du få från din finansiella rådgivare eller distributör.

Beloppet för den årliga avgiften grundas på kostnader för året som slutade i december 2020. Denna siffra kan variera från år till år. Det omfattar inte:

- Portföljens transaktionskostnader, utom i det fall då en insättnings- och uttagsavgift betalas av fonden vid köp eller försäljning av andelar i en annan fond.

För mer information om avgifter, gå till avsnittet "Avgifter och kostnader" i Prospektet och fondens Bilaga.

### Tidigare resultat



Tidigare resultat är ingen vägledning för framtida resultat.

Det tidigare resultat som visas här tar hänsyn till alla avgifter och kostnader. Insättnings- och uttagsavgifter ingår inte i beräkningen av tidigare resultat.

Fonden lanserades i Mars 2010.

Andelsklassen P lanserades i Februari 2015.

Det tidigare resultatet har beräknats i euro och uttrycks som en procentuell förändring av Fondens andelsvärde i slutet av varje år.

### Praktisk information

**Förvaringsinstitut** State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch.

**Ytterligare information** Kopior på Informationsbroschyren, dess Bilagor och senaste årsredovisning och halvårsrapport sammanställda för State Street Global Advisors Luxembourg SICAV kan erhållas kostnadsfritt från förvaltaren eller på internet [www.ssga.com](http://www.ssga.com). Handlingarna finns på engelska. För information om andra andelsklasser, se webbplatsen.

**Ersättningspolicy** Detaljerad information om den aktuella ersättningspolicyen för State Street Global Advisors Funds Management Limited finns tillgänglig på [www.ssga.com](http://www.ssga.com). Pappersexemplar är tillgängliga gratis på begäran.

**Publicering av andelarnas värdering** Andelsvärdet är tillgängligt på [www.ssga.com](http://www.ssga.com) samt vid bolagets säte.

**Skattelagstiftning** Denna fond omfattas av skattelagstiftningen och skattereglerna i Luxemburg. Beroende på ditt bosättningsland kan detta påverka dina investeringar. Tala med din skatterådgivare för ytterligare information.

**Ansvarsförklaring** State Street Global Advisors Funds Management Limited kan hållas ansvarigt om någon del av informationen i det här dokumentet är

missvisande, felaktig eller oförenlig med de relevanta delarna av fondens informationsbroschyr.

**Byte mellan fonder** Andelsägarna kan konvertera andelar till en annan andelsklass i samma delfond. Detaljerad information om byte mellan andelsklasser finns i avsnittet "Byte" i Prospektet. Kvalificeringskriterier för andelsklasserna finns i avsnittet "Andelsklasser" i Prospektet.

Varje begäran om att konvertera andelar från en delfond till en annan behandlas som inlösen från en delfond åtföljd av teckning i en annan delfond.

**Åtskiljande av tillgångar och skulder** State Street Global Advisors Luxembourg SICAV har separerade skulder mellan sina delfonder. Det innebär att fondens tillgångar inte är tillgängliga för att betala skulderna i någon annan delfond i State Street Global Advisors Luxembourg SICAV.

**Förordningen om hållbarhetsrelaterade upplysningar ("disclosureförordningen")** Detaljerad information om hur State Street Global Advisors Funds Management Limited beaktar hållbarhetsrisker i fondförvaltningens investeringsprocess framgår av informationsbroschyren samt på vår webbplats, [www.ssga.com](http://www.ssga.com).