

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über diesen Fonds. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses Fonds und die Risiken einer Anlage in ihn zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können. Hier nicht definierte Begriffe entsprechen der Definition im Verkaufsprospekt.

# State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund

(der „Fonds“), ein Teilfonds des State Street Global Advisors Luxembourg SICAV. Die Verwaltung dieses Fonds erfolgt durch State Street Global Advisors Europe Limited.

**Anteilsklasse: I Shares (ISIN LU2243635328)**

## Ziele und Anlagepolitik

**Anlageziel** Der Fonds strebt die Erwirtschaftung langfristigen Kapitalzuwachses durch Anlagen am Markt für festverzinsliche, auf US-Dollar lautende Investment-Grade-Unternehmensanleihen an.

**Anlagepolitik** Die Anlagepolitik des Fonds besteht darin, in Anleihen von Unternehmen zu investieren, die aktuell und in der Zukunft geringere Kohlenstoffemissionen aufweisen (gemessen an den Reserven fossiler Brennstoffe), in grüne Anleihen und Anleihen klimafreundlicher Emittenten sowie in Anleihen von Unternehmen, die für die physischen Risiken des Klimawandels besser gewappnet sind. Gleichzeitig werden Wertpapiere auf Basis der Beurteilung ihrer Einhaltung von ESG-Kriterien (z. B. internationale Normen in Bereichen wie Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsstandards, Korruptionsbekämpfung, umstrittene Waffen und Tabak) herausgefiltert. Der Anlageverwalter investiert aktiv im Auftrag des Fonds mittels der „Sustainable Climate Corporate Bond Strategy“, die im Abschnitt „Anlagestrategien“ des Prospekts genauer beschrieben wird. Die Performance des Fonds wird gegenüber jener des Bloomberg Barclays US Corporate Bond Index gemessen. 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. Die Anlagestrategie verwendet definierte Risikoparameter, wodurch die Gewichtung des Fonds im Kreditrating, in Sektoren und in Emittenten gegenüber dem jeweiligen Index begrenzt wird. Dies wird voraussichtlich das Ausmaß begrenzen, in dem der

Fonds die Wertentwicklung des Bloomberg Barclays US Corporate Bond Index übertreffen kann.

Um sein Anlageziel zu erreichen, wird dieser Fonds ausschließlich in folgende Anlagen investieren:

- Unternehmensanleihen;
- andere Fonds;
- liquide Mittel; und
- Derivate (zu Zwecken einer effizienten Portfolioverwaltung und zu Anlagezwecken), beschränkt auf Swaps, Optionen, Futures und Devisenterminkontrakte.

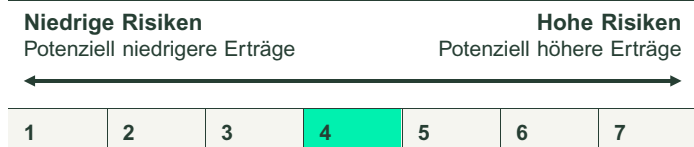
Der Fonds kann bis zu 70% der Wertpapiere in seinem Besitz beileihen. Die Anteile des Fonds werden in US-Dollar ausgegeben.

Anteilinhaber können ihre Anteile an jedem Geschäftstag in Luxemburg und im Vereinigten Königreich (außer an Tagen, an denen die betreffenden Finanzmärkte für den Geschäftsverkehr geschlossen sind, und/oder am Tag vor einem solchen Tag, wobei eine Liste dieser Marktschließstage für den Fonds auf [www.ssga.com](http://www.ssga.com) veröffentlicht wird) sowie an jedem anderen vom Verwaltungsrat im eigenen (vernünftigen) Ermessen festgelegten Tag zurücknehmen lassen, wobei die Anteilinhaber im Voraus über diese Tage informiert werden.

Vom Fonds erzielte Erträge werden im Fonds belassen, d. h. nicht ausgeschüttet, und erhöhen so den Wert der Anteile.

Weitere Informationen können dem Prospekt entnommen werden.

## Risiko- und Ertragsprofil



**Risikohaftungsausschluss** Vorstehende Risikokategorie ist kein Maßstab für Kapitalverluste oder -gewinne, sondern dafür, wie stark der Fondsertrag in der Vergangenheit gestiegen und gefallen ist.

Ein Fonds, dessen Ertrag stark gestiegen und gefallen ist, fällt in eine höhere Risikokategorie, ein Fonds, dessen Ertrag weniger stark gestiegen und gefallen ist, dagegen in eine niedrigere Risikokategorie.

Die niedrigste Risikokategorie (d. h. Kategorie 1) sagt nicht aus, dass es sich bei dem Fonds um eine risikofreie Anlage handelt.

Da die Risikokategorie des Fonds anhand historischer, simulierter Näherungsdaten berechnet wurde, kann sie nicht unbedingt als verlässlicher Hinweis auf das künftige Risikoprofil des Fonds herangezogen werden.

Die ausgewiesene Risikokategorie des Fonds kann durchaus Veränderungen unterliegen und die Einstufung kann sich im Laufe der Zeit verändern.

**Warum wurde dieser Fonds in diese Kategorie eingestuft?** Der Fonds wurde in Risikokategorie 4 eingestuft, da seine Rendite in der Vergangenheit mittleren Schwankungen ausgesetzt war.

Bei den folgenden Risiken handelt es sich um wesentliche Risiken für den Fonds, die in der obigen Risikokategorie nicht angemessen widerspiegelt werden.

**Währungsabsicherungsrisiko:** Absicherungsgeschäfte unterliegen bisweilen einer unvollkommenen Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem Risiko, das abgesichert werden soll. Es kann nicht zugesichert werden, dass die Absicherungsgeschäfte des Fonds effektiv sein werden. Da das Ziel einer Währungsabsicherung darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu verringern oder zu vermeiden, kann diese auch Gewinne verringern oder zunichte machen, wenn sich die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, verteuert.

**ESG-Risiko:** Wenn der Teilfonds bei der Anlage in Unternehmen ESG-Kriterien (Environmental, Social, Corporate Governance – Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) berücksichtigt, kann die Performance des Teilfonds den Renditen eines Wertpapierportfolios folgen, das Unternehmen enthält, die nicht aufgrund solcher ESG-Kriterien ausgeschlossen sind. Die ausschließliche Anlage in ein Portfolio von Wertpapieren, die nicht aufgrund

solcher ESG-Kriterien ausgeschlossen sind, kann sich auf das Engagement des Teilfonds in bestimmten Anlageformen auswirken und die Performance des Teilfonds nachteilig beeinflussen.

**Liquiditätsrisiko:** Das Fehlen eines zur Verfügung stehenden Markts oder Beschränkungen hinsichtlich des Wiederverkaufs können die Fähigkeit des Fonds zum Verkauf eines Wertpapiers zu einem günstigen Zeitpunkt, zu einem vorteilhaften Preis oder überhaupt beschränken. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren, liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Die Illiquidität von Positionen des Fonds kann die Fähigkeit des Fonds zur Erlangung von Barmitteln zur termingerechten Erfüllung von Rücknahmearträgen beschränken.

**Modellrisiko:** Der Anlageverwalter nutzt quantitative Modelle zu Zwecken der Renditesteigerung und des Risikomanagements. Mängel, Fehler oder Beschränkungen dieser Modelle oder bei deren Programmierung könnten einen möglichen Nutzen für den Fonds aus der Verwendung dieser Modelle beschränken oder könnten zu fehlerhaften Ausgaben oder zu Anlageergebnissen führen, die von jenen abweichen oder jenen entgegengesetzt sind, die der Anlageverwalter erwartet oder angestrebt hatte. Solche Mängel, Fehler oder Beschränkungen werden möglicherweise niemals erkannt oder erst erkannt, nachdem ein Fonds einen Verlust (oder eine verringerte Performance) erlitten hat. Darüber hinaus kann nicht zugesichert werden, dass sich die Modelle unter allen Marktbedingungen erwartungsgemäß verhalten.

**Risiko von Wertpapierleihgeschäften:** Falls der Fonds Wertpapierleihgeschäfte tätigt, besteht das Risiko, dass der Leihnehmer seinen Verpflichtungen zur Rückgabe von den entliehenen Wertpapieren gleichwertigen Wertpapieren nicht nachkommt. Damit ist der Fonds dem Ausfallrisiko ausgesetzt. In diesem Fall können dem Fonds außerdem Verzögerungen bei der Beitreibung der Wertpapiere und somit ein Kapitalverlust entstehen. Der Fonds könnte auch Geld verlieren, wenn der Wert gehaltener Sicherheiten gegenüber jenem der verliehenen Wertpapiere fällt.

**Anteilsklassenrisiko:** Es besteht keine Trennung hinsichtlich der Verbindlichkeiten zwischen den Klassen des Fonds. Zwar wird der Anlageverwalter bestrebt sein sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus den entsprechenden derivativen Instrumente in Verbindung mit einer Währungsabsicherungsstrategie sowie deren Kosten ausschließlich für die Klasse verbucht werden, für die sie vorgesehen sind, doch könnten die Transaktionen zu Verbindlichkeiten für andere Klassen führen.

**Integration von Nachhaltigkeitsrisiken:** Die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken in den Anlageprozess des Fonds stellt nicht sicher, dass alle oder einzelne Nachhaltigkeitsrisiken gemindert werden. Jede Verschlechterung des Finanzprofils einer von einem Nachhaltigkeitsrisiko betroffenen zugrunde liegenden Anlage kann sich entsprechend negativ auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds auswirken.

**SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko:** Die SFDR wird stufenweise ab dem 10. März 2021 eingeführt und bringt neue Offenlegungspflichten für Finanzmarktteilnehmer mit sich. Zum Datum des Prospekts sind die technischen Durchführungsstandards (Stufe 2) für SFDR zwar veröffentlicht,

aber noch nicht von der Europäischen Kommission verabschiedet worden. Zudem sind bestimmte mit der SFDR neu eingeführte Konzepte derzeit nicht Gegenstand zentraler Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder etablierter Marktgepflogenheiten. Der Fonds wurde nach Treu und Glauben auf Grundlage der derzeit verfügbaren relevanten Informationen bewertet und eingestuft. Da sich diese Standards und Richtlinien weiterentwickeln, können die in der Ergänzung und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Angaben und die **Artikel 9-Klassifizierung** Änderungen unterliegen und möglicherweise nicht mehr gelten. Die vollständigen Angaben zu den mit diesem Fonds verbundenen Risiken sind dem Prospekt zu entnehmen.

### Kosten

Die von Ihnen getragenen Kosten werden zur Verwaltung des Fonds aufgewendet, einschließlich der Vermarktung und des Vertriebs der Fondsanteile. Diese Kosten beschränken das potenzielle Wachstum Ihrer Anlage.

Bei den ausgewiesenen Ausgabeauf- und Rücknahmeabschlägen handelt es sich um die Höchstbeträge. In einigen Fällen könnten Sie weniger zahlen – dies können Sie bei Ihrem Finanzberater oder der für Sie zuständigen Stelle in Erfahrung bringen.

Bei den an dieser Stelle ausgewiesenen laufenden Kosten handelt es sich um eine Kostenschätzung. Sie enthält nicht:

- Portfoliotransaktionskosten mit Ausnahme etwaiger Ausgabeaufschläge oder Rücknahmeabschläge, die der Fonds beim Kauf oder Verkauf von Anteilen eines anderen Fonds zahlen muss.

Weitere Informationen zu den Kosten sind dem Abschnitt „Gebühren und Aufwendungen“ des Prospekts sowie dem Nachtrag zum Prospekt des Fonds zu entnehmen.

#### Einmalige Kosten vor und nach der Anlage

Ausgabeaufschlag	0,00%
Rücknahmeabschlag	2,00%

Dabei handelt es sich um den Höchstbetrag, der von Ihrer Anlage vor der Anlage (Ausgabeaufschlag) und vor der Auszahlung der Erlöse aus dem Verkauf Ihrer Anteile (Rücknahmeabschlag) abgezogen wird.

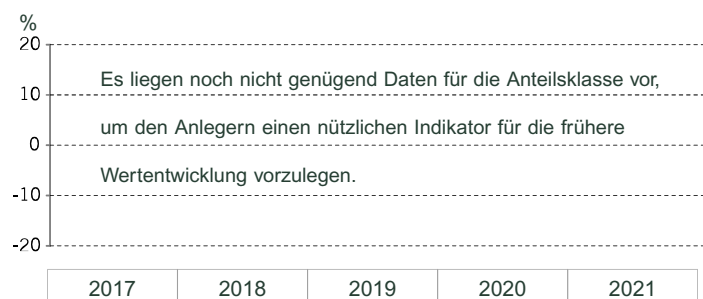
#### Kosten, die dem Fonds im Laufe eines Jahres belastet wurden

Laufende Kosten	0,32%
-----------------	-------

#### An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren

Performancegebühr	keine
-------------------	-------

### Wertentwicklungen der Vergangenheit



### Praktische Informationen

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

**Weitere Informationen** Exemplare des Prospekts und der jeweiligen Zusatzprospekte sowie die jüngsten, für State Street Global Advisors Luxembourg SICAV erstellten Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos bei der Verwaltungsstelle oder im Internet unter [www.ssga.com](http://www.ssga.com) bezogen werden. Diese Dokumente liegen in englischer Sprache vor. Informationen zu weiteren Anteilsklassen finden Sie auf der Website.

Der Prospekt, die wesentlichen Informationen für den Anleger, die Satzung der Gesellschaft sowie die Jahres- und Halbjahresberichte sind kostenlos vom Vertreter in der Schweiz unter folgender Adresse erhältlich: State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich, Beethovenstraße 19, Postfach, 8027 Zürich. Die Zahlstelle der Gesellschaft in der Schweiz ist die State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich, Beethovenstraße 19, Postfach, 8027 Zürich.

**Vergütungspolitik** Details zur aktuellen Vergütungspolitik des State Street Global Advisors Europe Limited sind zugänglich über [www.ssga.com](http://www.ssga.com). Auf Anfrage wird kostenlos eine Papierversion zur Verfügung gestellt.

**Veröffentlichung des Nettoinventarwerts** Der Nettoinventarwert je Anteil ist unter [www.ssga.com](http://www.ssga.com) abrufbar und kann auch am eingetragenen Geschäftssitz der Gesellschaft in Erfahrung gebracht werden.

**Steuerrecht** Der Fonds unterliegt den Steuergesetzen und -vorschriften von Luxemburg. Je nachdem, in welchem Land Sie Ihren Wohnsitz haben, könnte dies einen Einfluss auf Ihre Anlagen haben. Um sich genauer zu informieren, sollten Sie einen Steuerberater zu Rate ziehen.

**Haftungserklärung** State Street Global Advisors Europe Limited kann lediglich für in diesem Dokument enthaltene Erklärungen haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des Prospekts für den Fonds vereinbar sind.

**Umschichtung zwischen Teilfonds** Anteilinhaber können Anteile in andere Anteilsklassen desselben Teilfonds umtauschen. Detaillierte Informationen zum Umtausch zwischen Anteilsklassen finden Sie im Prospekt unter „Umtausch“. Die Berechtigungskriterien für die Anteilsklassen finden Sie im Prospekt unter „Anteilsklassen“.

Jeder Antrag auf Umtausch von Anteilen eines Teilfonds in Anteile eines anderen Teilfonds wird als Rücknahme von Anteilen eines Teilfonds gefolgt von einer Zeichnung von Anteilen eines anderen Teilfonds behandelt.

**Trennung von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten** State Street Global Advisors Luxembourg SICAV verfährt nach dem Prinzip der Haftungstrennung zwischen seinen Teilfonds. Infolgedessen sollten die Vermögenswerte des Fonds nicht für eine Zahlung der Schulden eines anderen Teilfonds des State Street Global Advisors Luxembourg SICAV verfügbar sein.

**Offenlegungsverordnung („SFDR“)** Detaillierte Informationen darüber, wie State Street Global Advisors Europe Limited Nachhaltigkeitsrisiken im Anlageprozess bei der Verwaltung des Fonds berücksichtigt, finden Sie im Prospekt und auf unserer Website unter [www.ssga.com](http://www.ssga.com).