

State Street Europe Small Cap Screened Equity Fund

State Street Global
Advisors Luxembourg
SICAV

Informationsblatt
Aktien

31 Mai 2026

Anlageziel des Fonds

Das Ziel des Fonds besteht darin, eine Rendite zu liefern, die die Performance der europäischen Small-Cap-Aktienmärkte übersteigt.

Umwelt, Soziales & Unternehmensführung (ESG)

Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, verfolgt aber nachhaltige Investitionen nicht als eines seiner Ziele. Der Fonds wurde nach Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („Offenlegungsverordnung“) eingestuft.

Die wichtigsten methodischen Einschränkungen: Es ist möglich, dass ESG-Daten unstimmtig, ungenau oder nicht ausreichend verfügbar sind, insbesondere wenn diese Angaben von externen Datenanbietern eingeholt werden. Die Einschränkungen sind im Prospekt ausführlicher beschrieben.

Weitere Informationen zu den ESG-Merkmalen, der ESG-Strategie, dem Investmentprozess und dem angewandten Ansatz finden Sie im Prospekt.

Anlagestrategie

Die Anlagepolitik des Fonds besteht darin, den MSCI Europe Small Cap Index (oder einen anderen Index, der vom Verwaltungsrat jeweils festgelegt wird und im Wesentlichen denselben Markt wie der Index abbildet) mittel- und langfristige zu übertreffen.

Die Anlagepolitik beinhaltet auch das Herausfiltern von Wertpapieren auf Basis der Beurteilung ihrer Einhaltung von ESG-Kriterien (d. h. internationaler Normen im Zusammenhang mit Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards, Korruptionsbekämpfung und umstrittenen Waffen).

Fondsdaten

Anteilsklasse	[P Distributing] Alle Anleger
Benchmark	MSCI Europe Small Cap Index
Struktur	Investment Company
UCITS-konform	Ja
Domizil	Luxemburg

Fondsdaten

ISIN	LU1648466958
NAV	17,36 EUR per 29 Mai 2026
Währung	EUR
Fondsvolumen (NAV) (Mio.)	35,87 EUR per 29 Mai 2026
Auflagedatum	21 September 2017
SFDR-Fondsklassifizierung	SFDR – Artikel 8
Anlagestil	Aktiv
Land/Region	Europa
Abrechnung	Zyklus für die Abrechnung von Rücknahmen, DD+2; Zyklus für die Abrechnung von Zeichnungen, DD+2
Mitteilungsfrist	DD 11:00 Uhr MEZ
Bewertung	Täglich, Börsenschluss
Swingfaktor ¹	
Kauf	0,20%
Verkauf	0,02%
Einmalanlage	EUR 50,00
Folgeinvestments	EUR 50,00
Managementgebühren	1,5%
Tatsächliche TER	1,64%
Gebühren, die an den Fonds gezahlt wurden	Kauf: k.A. Verkauf: Bis zu 0%

¹ Anhaltspunkt zum Datum dieses Factsheets, Änderungen vorbehalten

Wertentwicklung					
	Benchmark	Fonds vor Kosten (brutto)	Differenz	Fonds nach Kosten (netto)	Differenz

Annualisiert (%)

1 Jahr	14,45	22,65	8,20	20,68	6,23
3 Jahre	12,84	20,18	7,34	18,29	5,45
5 Jahre	4,48	10,22	5,73	8,46	3,98
Seit Auflage	6,63	10,24	3,61	8,48	1,85

Kumuliert (%)

1 Monat	4,05	4,66	0,61	4,52	0,47
3 Monate	2,54	2,12	-0,42	1,71	-0,83
1 Jahr	14,45	22,65	8,20	20,68	6,23
3 Jahre	43,70	73,62	29,92	65,54	21,84
5 Jahre	24,51	62,64	38,13	50,11	25,60
Seit Auflage	74,76	133,45	58,68	102,90	28,14

Kalenderjahr (%)

2026 (YTD)	8,68	10,55	1,87	9,81	1,13
2025	16,35	27,72	11,37	25,81	9,46
2024	5,65	12,71	7,05	10,89	5,23
2023	12,74	13,30	0,56	11,47	-1,27
2022	-22,50	-16,35	6,15	-17,70	4,80

Die Wertentwicklung der Vergangenheit ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse.

Eine Anlage ist mit Risiken verbunden, einschließlich des Risikos eines Kapitalverlusts.

Die hierin enthaltenen Zahlen zur Wertentwicklung werden vor und nach Abzug von Gebühren angegeben. Der Abzug von Gebühren berücksichtigt nicht den Abzug von Beratungs- oder sonstigen Gebühren, welche die Rendite schmälern könnten. Die Indexrenditen reflektieren Kapitalgewinne und -verluste, Erträge und die Wiederanlage von Dividenden. Die Wertentwicklung berücksichtigt die Wiederanlage von Dividenden und sonstigen Unternehmensgewinnen und wird in der Währung berechnet, die in den Fondsdaten angegeben ist.

Für das Kalenderjahr, in das das Auflegungsdatum entweder des betreffenden Fonds oder des an die vergangene Wertentwicklung gebundenen Fonds fällt (je nachdem welches das frühere Datum ist), ist die Angabe der Wertentwicklung im Kalenderjahr unvollständig.

Die Berechnungsmethode für Value-Added-Renditen kann Rundungsdifferenzen aufweisen.

Sind bei einer Schließung des Fonds gemäß seinem offiziellen Nettoinventarwert (NAV)-Kalender Preise für einen maßgeblichen Teil der zugrunde liegenden Wertpapiere ermittelbar, so wird ein technischer NAV berechnet. Die angegebene frühere Wertentwicklung wurde daher erforderlichenfalls auf Grundlage eines technischen NAV und des offiziellen NAV des Fonds zu jedem anderen Geschäftstag des betreffenden Zeitraums berechnet.

Vor dem 30 April 2025 war der Fonds unter der Bezeichnung State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund.

Quelle: State Street Investment Management.

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 31/05/2026

Merkmale

	Fonds	Benchmark
Durchschnittlich gewichtete Marktkapitalisierung (in Mio.)	€2 815	€3 065
Durchschnittliches Preis/Buch-Verhältnis	1,64	1,68
Erwartetes KGV (nächste 12 Monate)	12,75	15,13
Gewichtetes Preis/Cash Flow Verhältnis	5,96	8,43
Dividendenrendite (%)	3,57	2,87
Anzahl der Vermögenswerte*	194	839

* Die Anzahl von dem Fond notierten Stammaktien kann cash Positionen enthalten.

Kennzahlen	3 Jahre
Standardabweichung (%)	12,18
Tracking Error (%)	3,47
Beta	0,90

Top-10-Positionen	Gewichtung (%)
IMI PLC	1,53
IG GROUP HOLDINGS PLC	1,47
UMICORE	1,45
VOESTALPINE AG	1,43
KONINKLIJKE BAM GROEP NV	1,36
JYSKE BANK-REG	1,35
BALFOUR BEATTY PLC	1,32
JOHNSON MATTHEY PLC	1,30
INCHCAPE PLC	1,23
SBM OFFSHORE NV	1,23

Branchen

	Fonds (%)	Benchmark (%)
Industrieunternehmen	27,62	26,21
Finanzen	16,69	15,41
Nicht-Basiskonsumgüter	12,45	10,34
Material	7,88	8,55
Immobilien	7,20	8,41
Gesundheitswesen	7,05	6,96
Energie	6,22	5,07
Informationstechnologie	6,02	8,13
Versorgungsunternehmen	3,69	2,30
Kommunikationsdienste	3,12	5,05
Basiskonsumgüter	2,07	3,57
Gesamt	100,00	100,00

Länder

	Fonds (%)	Benchmark (%)
Großbritannien	28,39	27,66
Schweden	11,64	11,67
Frankreich	8,78	9,32
Schweiz	8,27	10,06
Deutschland	7,98	9,42
Norwegen	6,67	5,44
Italien	5,46	6,41
Belgien	4,78	3,56
Dänemark	4,57	4,29
Niederlande	3,84	3,26
Andere	9,62	8,91
Gesamt	100,00	100,00

Quelle: State Street Investment Management.

Die angegebenen Merkmale, Bestände, Länderallokationen und Sektoren beziehen sich auf das ganz oben auf diesem Factsheet angegebene Datum und können sich ändern.

„Sonstige“ bezeichnet bei Ländern den Zusammenschluss von Ländern, die nicht bereits in den Top-10 des Fonds enthalten sind.

Bitte beachten Sie, dass vollständige Einzelheiten zu den dem Fonds zugrunde liegenden Beständen auf [statestreet.com/im](https://www.statestreet.com/im) enthalten sind

Kontaktieren Sie uns

Besuchen Sie unsere Website statestreet.com/im oder wenden Sie sich an Ihre State Street Investment Management-Niederlassung vor Ort.

Belgium

+32 (0) 2 663 2016

France

+33 (0) 1 44 45 40 48

Germany

+49 (0) 89 55878 999

Ireland

+353 (1) 776 3000

Italy

+39 02 3206 6121

Middle East & Africa

+971 2 245 9000

Netherlands

+31 (0) 20 718 1701

Switzerland

+41 (0) 44 245 7099

United Kingdom

+44 (0) 20 3395 2333

statestreet.com/im

Marketingmitteilung
Allgemeiner Zugang. Nur für
professionelle Kunden.

State Street Global Advisors (SSGA) heisst jetzt State Street Investment Management. Bitte besuchen Sie unsere Website statestreet.com/investment-management für weitere Informationen.

Dieses Material dient Ihrer persönlichen Information. Die hier erteilten Informationen stellen keine Anlageberatung gemäß Definition nach der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente (2014/65/EU) oder geltenden Schweizer Vorschriften dar und sollten nicht als Grundlage für eine Anlageentscheidung herangezogen werden. Es werden keine Erklärungen oder Zusicherungen bezüglich der Richtigkeit der Informationen abgegeben, und State Street haftet nicht für Entscheidungen, die auf Basis dieser

Informationen getroffen werden.

Bitte lesen Sie die aktuellen wesentlichen Anlegerinformationen (WAI) und den Prospekt des Fonds, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen. Die aktuelle englische Fassung des Prospekts und der WAI finden Sie unter www.statestreet.com/im. Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte finden Sie hier: <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights/ssga-investors-rights-summary-template-non-etf-Lux.pdf> Beachten Sie, dass die Verwaltungsgesellschaft beschließen kann, die für die Vermarktung getroffenen Vereinbarungen zu beenden und die Notifizierung gemäß Artikel 93a der Richtlinie 2009/65/EG zu lösen.

Diese Informationen sind für professionelle Kunden bestimmt (wzu auch geeignete Gegenparteien gehören), die sowohl als sachkundig sowie als erfahren in Angelegenheiten im Zusammenhang mit Anlagen gelten.

Bei den in dieser Kommunikation enthaltenen Informationen handelt es sich nicht um eine Analystenempfehlung oder „Investment Research“, sie sind vielmehr im Sinne anwendbarer aufsichtsrechtlicher Vorgaben als „Marketingmitteilung“ klassifiziert. Dies bedeutet, dass diese Marketingmitteilung (a) nicht gemäß Rechtsvorschriften erstellt wurde, die die Unabhängigkeit von Investment Research fördern sollen, und (b) keinem zeitlichen Handelsverbot in Bezug auf den Handel vor der Verbreitung von Investment Research unterliegt.

Diese kollektive Kapitalanlage und ihre Vertriebsstelle sind von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht (FINMA) nach dem Kollektivanlagengesetz (KAG) und der Schweizer Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (Kollektivanlagenverordnung, KKV) zugelassen. Die kollektive Kapitalanlage wurde nach dem Recht Luxemburgs als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) strukturiert und ist

als OGAW von der Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) zugelassen. Potenzielle Anleger können den aktuellen Prospekt, die Satzung, die wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) sowie den letzten Jahres- und Halbjahresbericht kostenlos von der Vertretung und Zahlstelle in der Schweiz, State Street Bank International GmbH, München, Niederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, CH-8027 Zürich, beziehen.

Dieses Werk darf ohne ausdrückliche schriftliche Einwilligung von SSGA weder ganz noch teilweise vervielfältigt, kopiert oder übertragen und sein Inhalt gegenüber Dritten nicht offen gelegt werden. Der MSCI Europe Small Cap Index ist eine Marke der MSCI Inc.

© 2026 State Street Corporation.
Alle Rechte vorbehalten.
Fälligkeit: 20/07/2026