

State Street Climate Transition Euro Corporate Bond Beta Fund

State Street Global
Advisors Luxembourg
SICAV

Anlageziel des Fonds

Der Fonds strebt die Erwirtschaftung langfristigen Kapitalzuwachses durch Anlagen am Markt für auf Euro lautende festverzinsliche Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating an.

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, 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 Euro Aggregate Corporate Bond Index gemessen.

Fondsinformationen

Anteilsklasse	[B GBP] Institutionelle Investoren
Benchmark	BLOOMBERG EURO-AGGREGATE: CORPORATES
Struktur	Investment Company
UCITS-konform	Ja
Domizil	Luxemburg

Fondsdaten	
ISIN	LU3045484873
NAV	10,13 GBP per 31 Oktober 2025
Währung	GBP
Fondsvolumen (NAV) (Mio.)	351,93 EUR per 31 Oktober 2025
Auflagedatum	29 September 2025
SFDR-Fondsklassifizierung	SFDR – Artikel 8
Anlagestil	Smart Beta
Land/Region	Economic Monetary Union/Eurozone
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	0.25%
Verkauf	0.00%
Einmalanlage	GBP 10 000 000,00
Folgeinvestments	GBP 5 000,00
Managementgebühren	0%
Tatsächliche TER	k.A.
Gebühren, die an den Fonds gezahlt wurden	Kauf: k.A. Verkauf: Bis zu 2%

¹ Anhaltspunkt zum Datum dieses Factsheets, Änderungen vorbehalten

Die Wertentwicklung des Fonds ist nicht angegeben, da die Auflegung des Fonds vor weniger als 12 Monaten erfolgte.

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

Merkmale		
	Fonds	Benchmark
Anzahl der Vermögenswerte*	1 697	3 963
Durchschnittliche (optionsbereinigte) Endfälligkeitsrendite (%)	2,98	2,98
Rückzahlungsrendite (%)	2,99	2,99
Laufende Rendite (%)	2,77	2,79
Durchschnittlicher Kupon (%)	2,81	2,82
Optionsbereinigter Spread (in Basispunkten)	77,33	76,76
Effektive Duration (Jahre)	4,50	4,51
Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre)	5,12	5,12
Effektive Konvexität	0,30	0,30
Durchschnittliches Rating	BAA1	BAA1

* Die Anzahl von dem Fond notierten Emissionen kann cash positionen enthalten.

Kennzahlen	3 Jahre
Standardabweichung (%)	-
Tracking Error (%)	-
Beta	-

Länder		
	Fonds (%)	Benchmark (%)
USA	20,61	21,64
Frankreich	18,06	19,09
Deutschland	12,14	13,10
Großbritannien	8,21	8,14
Niederlande	5,73	4,85
Spanien	5,43	5,92
Italien	4,96	5,69
Schweden	3,98	3,04
Belgien	2,42	2,16
Dänemark	2,37	2,00
Andere	16,08	14,37
Gesamt	100,00	100,00

Branchen		
	Fonds (%)	Benchmark (%)
Industrien	48,05	48,81
Finanzsektor	43,69	43,00
Versorger	8,04	8,19
Cash	0,22	-
Gesamt	100,00	100,00

Kreditrating-Positionen		
	Fonds (%)	Benchmark (%)
Aaa	0,52	0,39
Aa	6,96	6,78
A	41,77	42,07
Baa	50,74	50,76
Gesamt	100,00	100,00

Fälligkeiten		
	Fonds (%)	Benchmark (%)
0 - 1 Jahr	0,22	-
1 - 3 Jahre	30,55	30,44
3 - 5 Jahre	26,23	27,64
5 - 7 Jahre	21,07	19,71
7 - 10 Jahre	15,43	15,67
10 - 20 Jahre	6,07	6,09
> 20 Jahre	0,44	0,45

Quelle: State Street Investment Management.
Die angegebenen Merkmale, Kreditrating-Positionen, 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.
Die Bonitätsbewertung basiert auf einem Durchschnitt von Moody's, S & P und Fitch.
Bitte beachten Sie, dass vollständige einzelheiten zu den dem fonds zugrunde liegenden beständen auf 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

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 löschen. Diese Informationen sind für professionelle Kunden bestimmt (wozu 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.

„Bloomberg“™ und alle Bloomberg-Indizes sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und seinen verbundenen Unternehmen, einschließlich Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Verwalter des Index (zusammen „Bloomberg“), und wurden für bestimmte Zwecke von State Street Bank and Trust Company, durch seine Abteilung State

Street Global Advisors („SSGA“), lizenziert. Bloomberg ist nicht mit SSGA verbunden. Bloomberg genehmigt, befürwortet, prüft oder empfiehlt kein Produkt von SSGA. Bloomberg gibt keinerlei Garantien für die Aktualität, Genauigkeit oder Vollständigkeit von Daten oder Informationen in Bezug ein SSGA-Produkt ab. Die hierin erwähnten Marken und Dienstleistungsmarken sind Eigentum ihrer jeweiligen Inhaber. Unabhängige Datendienste machen keinerlei Zusicherungen oder Garantien bezüglich der Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität der Daten und haften nicht für Schäden jeglicher Art im Zusammenhang mit der Nutzung dieser Daten. 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.

© 2025 State Street Corporation.
Alle Rechte vorbehalten.
Tracking Number: 8638779.1.1.EMEA.INST
Fälligkeit: 20/12/2025