

# State Street<sup>®</sup> Blackstone Euro AAA CLO USD Hdg UCITS ETF (Acc)

Informationsblatt

31 Mai 2026

## Renten

### Anlageziel des Fonds

Anlageziel des Fonds ist es, langfristig risikobereinigte Renditen durch eine Kombination aus Erträgen und Kapitalwachstum zu erzielen. Dazu investiert der Fonds überwiegend in auf Euro lautende Investment-Grade-Tranchen von Collateralised Loan Obligations („CLOs“).

### Anlagestrategie

Der Fonds wird aktiv verwaltet. Die Anlagepolitik des Fonds besteht darin, bis zu 100 % seines Nettovermögens in Tranchen mit AAA-Rating von auf Euro lautenden Schuldtiteln zu investieren, die von CLOs ausgegeben werden und Zugang zu vorrangig besicherten europäischen Unternehmensanleihen und -krediten bieten.

### Steuerstatus

Standardgemäß ist die State Street Investment Management bestrebt, alle geltenden steuerlichen Berichtspflichten für alle SPDR ETFs in den folgenden Ländern einzuhalten. Anmeldungen erfolgen je nach der Zeitskala, die von der jeweiligen Steuerbehörde vorgegeben wird, das ganze Jahr über: Großbritannien, Deutschland, Österreich, Schweiz.

### Länder mit Vertriebszulassung

Spanien, Schweden, Österreich, Norwegen, Niederlande, Luxemburg, Italien, Irland, Großbritannien, Frankreich, Finnland, Deutschland, Dänemark

### Fondsinformationen

ISIN	IE000NAFAKL6
------	--------------

### Schlüsselfaktoren

Auflegedatum	16-Mar-2026
Share Class Währung	USD
Fonds — Basiswährung	EUR
TER	0,30%
Ertragsverwendung	Thesaurierend
UCITS-konform	Ja
Domizil	Irland
Investment Manager	State Street Global Advisors Europe Limited
Unteranlageverwalter	Blackstone Liquid Credit Strategies LLC
Fonds-Umbrella	SSGA SPDR ETFs Europe II plc
Volumen aller Anteilsklassen (Mio.)	US\$222,76
ISA berechtigt	Ja
SIPP berechtigt	Ja
PEA berechtigt	Keine

### Notierung

Börse	Börsenticker	Handelswährung	iNAV Code	Bloomberg Code	Reuters Code	SEDOL Code
Deutsche Börse*	SPPB	USD	INSPPB	SPPB GY	SPPB.DE	BVMZK76

\*"Primary Listing"

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

<b>Fund Characteristics</b>	
Number of Holdings	69
Weighted Avg Life to Maturity	5.01
Modified Spread Duration to Worst	1.47
Yield to Maturity (%)	3.97

Source: Blackstone, 31st May 2026

<b>Top 10 Holdings</b>	<b>Weight (%)</b>
SCULE 5X ARR	2.64
NEUBE 2025-7X A1	2.53
ACLO 7X AR	2.42
ELMP 1X AR3	2.42
CORDA 37X A	2.42
PLMER 2025-2X A	2.31
TIKEH 4X AR	2.20
PENTA 2022-11X ARR	2.20
BILB 2X A1RR	2.19
RRME 27X A1	1.98

Source: Blackstone, 31st May 2026

<b>Credit Quality Breakdown</b>	<b>Weight (%)</b>
AAA	100

<b>Sector Breakdown</b>	<b>Weight (%)</b>
CLO	100

<b>Currency Breakdown</b>	<b>Weight (%)</b>
EUR	100

## Kontaktieren Sie uns

Besuchen Sie unsere Webseite [ssga.com/etfs](https://ssga.com/etfs) oder kontaktieren Sie Ihren lokalen SPDR ETF Vertreter. Alternativ können Sie auch das SPDR ETF Sales & Support Team über [spdrseurope@ssga.com](mailto:spdrseurope@ssga.com) erreichen.

**France & Luxembourg**  
[spdrETF\\_france@ssga.com](mailto:spdrETF_france@ssga.com)  
 +33 1 44 45 40 00

**Germany**  
[spdrGermany@ssga.com](mailto:spdrGermany@ssga.com)  
 +49 69 66774 5016

**Italy**  
[spdrETF\\_italia@ssga.com](mailto:spdrETF_italia@ssga.com)  
 +39 0232066 140

**Netherlands**  
[spdr\\_nl@ssga.com](mailto:spdr_nl@ssga.com)  
 +31 (0)20-7181071

**Nordics**  
[spdrseurope@ssga.com](mailto:spdrseurope@ssga.com)  
 +31 (0)20-7181071

**Spain**  
[spdrseurope@ssga.com](mailto:spdrseurope@ssga.com)  
 +39 0232066 140

**United Kingdom**  
[spdrseurope@ssga.com](mailto:spdrseurope@ssga.com)  
 +44 (0) 203 395 6888

**Capital Risk: Investing involves risk including the risk of loss of capital.**

**Past performance is not a reliable indicator of future performance.**

CLO Debt Securities carry certain structural risks including potential subordination to the other tranches of debt in the same capital structure, volatility of underlying collateral values and potential for principal loss of the underlying assets in excess of the equity valuation. CLOs issue classes or "tranches" of securities that vary in risk and yield. Losses caused by defaults on underlying assets are borne first by the holders of subordinate tranches.

The negative target market for the Fund is basic / informed "Retail Investors" as defined in the current European MiFID template. Accordingly, the sale of this Fund on the secondary market to basic or informed Retail Investors is not permitted and the Fund shall not be offered to Retail Investors other than advanced retail investors

## ssga.com/etfs

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

### Glossar

**Effektive Konvexität** Eine Kennzahl der Krümmung im Verhältnis zwischen Anleihenkursen und Anleiherenditen, die zeigt, wie sich die Duration einer Anleihe bei Zinsänderungen verändert.

**Effektive Duration** Eine Berechnung der Duration für Anleihen mit eingebetteten Optionen. Diese Durationskennzahl berücksichtigt die Tatsache, dass erwartete Cashflows bei Zinsänderungen schwanken. Die effektive Duration kann mittels der modifizierten Duration geschätzt werden, wenn eine Anleihe mit eingebetteten Optionen sich wie eine herkömmliche Anleihe ohne Optionen verhält.

**Rückzahlungsrendite** Die in Bezug auf eine Anleihe erwartete Gesamtrendite, wenn die Anleihe bis zur Fälligkeit gehalten wird. Die Rückzahlungsrendite wird als langfristige Anleiherendite erachtet, wird aber als jährlicher Satz angegeben. Anders ausgedrückt, es handelt sich um den internen Zinsfuß (IZF) einer Anlage in eine Anleihe, wenn der Anleger die Anleihe bis zur Fälligkeit hält und wenn alle Zahlungen planmäßig erfolgen.

**Ausschüttungsrendite** Die jährlichen Dividenden je Anteil des Fonds, dividiert durch den Anteilspreis des Fonds.

**Delta** Eine Kennzahl der Aktiensensitivität, die das Verhältnis zwischen einer prozentualen Veränderung im Aktienkurs und die entsprechende prozentuale Veränderung im Wandelanleihenkurs darstellt, sie wird auch als Preiselastizität bezeichnet.

**TER** Bei der Total Expense Ratio handelt es sich um eine Gebühr, die dem Fonds als Prozentsatz des Nettoinventarwerts zur Deckung der mit dem Betrieb und dem Management des Vermögensportfolios verbundenen Kosten erhoben wird.

### qualifizierte Anleger. Nicht für den öffentlichen Vertrieb.

Börsengehandelte Indexfonds (ETFs) werden wie Aktien gehandelt, unterliegen Anlagerisiken und ihr Marktwert schwankt. Der Wert der Anlage kann sowohl fallen als auch steigen, und die Rendite der Anlage ist deshalb veränderlich. Wechselkursänderungen können sich nachteilig auf Wert, Kurs oder Ertrag einer Anlage auswirken. Des Weiteren gibt es keine Garantie dafür, dass ein ETF sein Anlageziel erreichen wird.

### Marketingmitteilung

SPDR ETFs sind möglicherweise nicht für Sie erhältlich oder geeignet. Die hier erteilten Informationen stellen keine Anlageberatung gemäß Definition nach der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente (2014/65/EG) dar und sollten nicht als Grundlage für eine Anlageentscheidung herangezogen werden. Sie sind auch nicht als Aufforderung zum Kauf oder als Angebot zum Verkauf einer Anlage zu verstehen. Die bestimmten Anlageziele, Strategien, der steuerliche Status, die Risikobereitschaft bzw. der Anlagehorizont eines Anlegers oder potenziellen Anlegers sind darin nicht berücksichtigt.

Falls Sie Anlageberatung benötigen, sollten Sie sich an Ihren Steuer-, Finanz- oder sonstigen Fachberater wenden.

**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](http://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-spdr-investors-rights-summary.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.** Alle Dokumente in Bezug auf die Fonds sind kostenlos von den Geschäftsstellen des lokalen Vertreters/Vermittlers zu beziehen, stehen im Internet unter [www.statestreet.com/im](http://www.statestreet.com/im) zur Verfügung oder sind von State Street Custodial Services (Ireland) Limited, 78 Sir John

Rogerson's Quay, Dublin 2, Irland, erhältlich. SPDR ETFs ist die Plattform von State Street Global Advisors für börsengehandelte Indexfonds ("ETF") und enthält Fonds, die von der Central Bank of Ireland als offene OGAW-Investmentgesellschaften genehmigt wurden. Für US-Anleger sind die Fonds nicht erhältlich. SSGA SPDR ETFs Europe I plc und SPDR ETFs Europe II plc („die Gesellschaft“) emittieren SPDR ETFs und bilden eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und getrennter Haftung zwischen ihren Teilfonds. Die Gesellschaft ist als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) nach irischem Recht organisiert und als OGAW von der Central Bank of Ireland zugelassen.

**Zusätzliche wichtige Informationen: - Für Großbritannien** wurde dieses Dokument von State Street Global Advisors Limited („SSGA“) herausgegeben. Zugelassen und reguliert von der Financial Conduct Authority, registriert unter der Nr. 2509928. USt. Nr. 5776591 81. Eingetragener Sitz: 20 Churchill Place, Canary Wharf, London, E14 5HJ Telefon: 020 3395 6000, Fax: 020 3395 6350, Internet: [www.statestreet.com/im](http://www.statestreet.com/im). **Für die EU** wurde dieses Dokument von State Street Global Advisors Europe („SSGA“), reguliert von der Central Bank of Ireland, herausgegeben. Adresse des eingetragenen Sitzes: 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2. Registrierungsnummer 49934. Tel.: +353 (0)1 776 3000. Fax: +353 (0)1 776 3300. Internet: [www.statestreet.com/im](http://www.statestreet.com/im).

### Lokale Vertreter/Zahlstellen von SPDR ETFs:

**Frankreich:** State Street Bank International GmbH Paris Branch, Cœur Défense -Tour A, 100, Esplanade du Général de Gaulle, 92931 Paris La Defense Cedex; **Schweiz:** State Street Bank GmbH Munich, Niederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, 8027 Zürich, und die Hauptvertriebsstelle in der Schweiz, State Street Global Advisors AG, Beethovenstrasse 19, 8027 Zürich; **Deutschland:** State Street Global Advisors Europe Limited, Brienner Strasse 59, D-80333 München; **Spanien:** Cecabank, S.A. Alcalá 27, 28014 Madrid (Spanien); **Dänemark:** Nordea Bank Denmark A/S, Issuer Services, Securities Services Hermes Hus, Helgeshøj Allé 33 Postbox 850, DK-0900 Kopenhagen C; **Österreich:** Erste Bank, Graben 21, 1010 Wien, Österreich; **Schweden:** SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB, Global Transaction

Services ST MHI, SE-106 40 Stockholm, Schweden.

Der Fonds/die Anteilsklasse kann Finanzderivate zur Währungsabsicherung und zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Fonds kann nicht auf die Währung der Anteilsklasse lautende Wertpapiere kaufen. Hedging sollte die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen mindern. Absicherungsmaßnahmen bieten jedoch bisweilen keine optimale Abstimmung, was zu Verlusten führen könnte. Der S&P 500® Index ist ein Produkt von S&P Dow Jones Indices LLC oder seinen verbundenen Unternehmen („S&P DJI“), für dessen Verwendung State Street Global Advisors eine Lizenz gewährt wurde. S&P®, SPDR®, S&P 500®, US 500 und die 500 sind eingetragene Marken von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“); Dow Jones® ist eine eingetragene Marke von Dow Jones Trademark Holdings LLC („Dow Jones“) und wurde für die Verwendung durch S&P Dow Jones Indices lizenziert; und für die Verwendung dieser Marken wurde S&P DJI eine Lizenz und State Street Global Advisors eine Unterlizenz für bestimmte Zwecke gewährt. Der Fonds wird von S&P DJI, Dow Jones, S&P und ihren jeweiligen verbundenen Unternehmen weder gesponsort oder anderweitig unterstützt noch verkauft oder beworben; die genannten Parteien sichern in keiner Weise die Ratsamkeit der Investition in dieses Produkt/diese Produkte zu und haften nicht für Fehler, Auslassungen oder Unterbrechungen in der Berechnung und Verbreitung dieser Indizes. 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 offengelegt werden.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten. Tracking Number: Fälligkeit: 31/05/2027