

State Street Europe Small Cap Screened Equity Fund

State Street Global
Advisors Luxembourg
SICAV

UCITS ETF

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 langfristig 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).



Fondsinformationen

Anteilsklasse	UCITS ETF
Benchmark	MSCI Europe Small Cap SM
Struktur	Investment Company
UCITS-konform	Ja
Domizil	Luxemburg

Fondsdaten

ISIN	LU3121015484
NAV	11,76 EUR per 29 Mai 2026
Währung	EUR
Fondsvolumen (NAV) (Mio.)	35,87 EUR per 29 Mai 2026
Auflagedatum	25 November 2025
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
Einmalanlage	k.A.
Folgeinvestments	k.A.
Managementgebühren	0,75 %
Tatsächliche TER	0,85 %
Gebühren, die an den Fonds gezahlt wurden	Kauf: k.A. Verkauf: Bis zu 0%

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

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

Notierung

Börse	Börsenticker	Handelswährung	iNAV Code	Bloomberg Code	Reuters Code	SEDOL Code
Borsa Italiana*	SEAP	EUR	INSEAPE	SEAP IM	SEAP.MI	BSNT7G4
SIX Swiss Exchange	SEAP	EUR	INSEAPE	SEAPEUR SE	SEAPS	BTNNT23

**Primary Listing"

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 (%)	-
Tracking Error (%)	-
Beta	-

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 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 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.**

© 2026 Morningstar, Inc. Alle Rechte
vorbehalten. Die hierin enthaltenen
Informationen: (1) sind geschütztes Eigentum
von Morningstar und/oder seinen Inhalte-
Anbietern, (2) dürfen nicht kopiert oder verteilt
werden und (3) werden ohne Gewähr
hinsichtlich ihrer Korrektheit, Vollständigkeit
oder Aktualität bereitgestellt. Weder
Morningstar noch seine Inhalte-Anbieter sind
verantwortlich für Schäden oder Verluste, die
sich aus einer Verwendung dieser
Informationen ergeben. Die bisherige
Wertentwicklung ist keine Garantie für die
künftige Wertentwicklung.
Das Morningstar Medalist Rating™ ist die
Zusammenfassung der zukunftsorientierten
Analyse von Investmentstrategien durch
Morningstar, die über spezifische
Anlageinstrumente angeboten werden, und
wird auf einer Bewertungsskala von Gold, Silber,

Bronze, Neutral und Negativ dargestellt. Die
Medalist-Ratings zeigen an, welche Anlagen
Morningstar für wahrscheinlich besser
abschneidende Anlagen im Vergleich zu einem
relevanten Index oder einem Durchschnitt der
Vergleichsgruppe auf risikobasierter Basis im
Laufe der Zeit hält. Anlageprodukte werden
anhand der drei wichtigen Säulen „People“
(Team- bzw. Managementqualität), „Parent“
(übergeordneter Fondsanbieter) und „Process“
(Anlageprozess) bewertet, die in Verbindung mit
einer Gebühreneinschätzung die Grundlage für
Morningstars Überzeugung von den
Anlagevorzügen dieser Produkte bilden und das
zugewiesene Medalist-Rating bestimmen. Diese
Säulen können wie folgt bewertet werden:
Niedrig, Unterdurchschnittlich,
Durchschnittlich, Überdurchschnittlich und
Hoch. Die drei Säulen können anhand einer
qualitativen Bewertung durch einen Analysten
(entweder direkt für ein vom Analysten
beobachtetes Instrument oder indirekt, wenn
die Bewertungen der Säulen eines
beobachteten Instruments auf ein verwandtes,
nicht beobachtetes Instrument übertragen
werden) oder mithilfe algorithmischer Verfahren
bewertet werden. Anlageinstrumente werden
anhand ihrer erwarteten Performance in
Rating-Gruppen sortiert, die durch ihre
Morningstar-Kategorie und ihren aktiven oder
passiven Status definiert werden. Wenn
Analysten ein Anlageinstrument direkt
bewerten, vergeben sie auf der Grundlage ihrer
qualitativen Beurteilung unter Aufsicht des
Bewertungsausschusses der Analysten die
Ratings für die drei Säulen und überprüfen und
bewerten diese mindestens alle 14 Monate.
Wenn die Anlageinstrumente entweder indirekt
von Analysten oder mithilfe von Algorithmen
abgedeckt werden, werden die Ratings
monatlich zugewiesen. Für detailliertere
Informationen zu diesen Ratings, einschließlich

ihrer Methodik, besuchen Sie bitte global.morningstar.com/managerdisclosures/.
Die Morningstar Medalist Ratings stellen weder
Tatsachenbehauptungen noch Kredit- oder
Risikobewertungen dar. Das Morningstar
Medalist Rating (i) sollte nicht als alleinige
Grundlage für die Bewertung eines
Anlageprodukts verwendet werden, (ii)
beinhaltet unbekanntes Risiken und
Unsicherheiten, die dazu führen können, dass
Erwartungen nicht eintreten oder sich erheblich
von den Erwartungen unterscheiden, (iii) ist
nicht garantiert auf vollständigen oder genauen
Annahmen oder Modellen basierend, wenn es
algorithmisch bestimmt wird, (iv) beinhaltet das
Risiko, dass das Renditeziel aufgrund von
unvorhergesehenen Änderungen in
Management, Technologie, wirtschaftlicher
Entwicklung, Zinsentwicklung, Betriebs- und/
oder Materialkosten, Wettbewerbsdruck,
Aufsichtsrecht, Wechselkursen, Steuersätzen,
Wechselkursschwankungen und/oder
Änderungen der politischen und sozialen
Bedingungen nicht erreicht wird, und (v) sollte
nicht als Angebot oder Aufforderung zum Kauf
oder Verkauf des Anlageprodukts betrachtet
werden. Eine Änderung der zugrundeliegenden
Faktoren des Morningstar Medalist Rating kann
bedeuten, dass das Rating anschließend nicht
mehr zutreffend ist.
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