

Potenzielle Anleger sollten diesen Prospekt und den globalen Nachtrag (zusammen der „Prospekt“), die maßgeblichen Nachträge sowie die wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) sorgfältig und in ihrer Gesamtheit prüfen, und sich vor einer Entscheidung über eine Anlage in einen Fonds sich bei einem Wertpapiermakler, Bankberater, Rechts-, Steuer- oder sonstigen Finanzberater unabhängig über folgende Punkte informieren: (a) über die gesetzlichen Vorschriften ihres Landes in Bezug auf Kauf, Besitz, Umtausch, Rückgabe und Veräußerung von Anteilen, (b) über bestehende Devisenbeschränkungen ihres Landes in Bezug auf Kauf, Besitz, Umtausch, Rückgabe und Veräußerung von Anteilen, (c) über rechtliche, steuerliche, finanzielle und sonstige Folgen in Zusammenhang mit Zeichnung, Kauf, Halten, Umtausch, Rückgabe oder Veräußerung von Anteilen und (d) über die Bestimmungen dieses Prospekts und des bzw. der maßgeblichen Nachtrags/Nachträge.

SSGA SPDR ETFs Europe I plc

(Eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds nach irischem Recht gegründet wurde und von der Zentralbank gemäß der Verordnung von 2011 über Organismen für Gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (European Communities [Undertakings for Collective Investments in Transferable Securities] Regulations 2011) zugelassen wurde.)

KONSOLIDIERTER PROSPEKT FÜR DEUTSCHLAND 28. MAI 2026

DIESES DOKUMENT IST EIN KONSOLIDIERTER PROSPEKT, BESTEHEND AUS DEM VON DER IRISCHEN ZENTRALBANK GENEHMIGTEN PROSPEKT VOM 19. FEBRUAR 2026, ERGÄNZUNG ZUM PROSPEKT VOM 21. MAI 2026, DEM GLOBALEN NACHTRAG VOM 19. FEBRUAR 2026, NR.1 FÜR DEN STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF VOM 29. APRIL 2026, DEM NACHTRAG NR.2 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.3 FÜR DEN STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.4 FÜR DEN STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.5 FÜR DEN STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.6 FÜR DEN STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.9 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG EURO AGGREGATE BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.10 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG EURO GOVERNMENT BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.11 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG EURO CORPORATE BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.12 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG UK GILT UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.13 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG STERLING CORPORATE BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.14 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. AGGREGATE BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.15 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. TREASURY BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.17 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG EMERGING MARKETS LOCAL BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.18 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-5 YEAR GILT UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.19 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 15+ YEAR GILT UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.20 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-3 YEAR EURO GOVERNMENT BOND UCITS ETF 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.21 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG EURO HIGH YIELD BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.22 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P EMERGING MARKETS DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.23 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.24 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.25 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P UK DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.26 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.27 FÜR DEN STATE STREET SPDR FTSE UK ALL SHARE UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.28 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P 500 UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.31 FÜR DEN STATE STREET SPDR DOW JONES GLOBAL REAL ESTATE UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.32 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P 500 LOW VOLATILITY UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.33 FÜR DEN STATE STREET SPDR MSCI EMU UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.35 FÜR DEN

STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.36 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.37 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. HIGH YIELD CORPORATE SCORED UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.38 FÜR DEN STATE SPDR BLOOMBERG 0-3 YEAR EURO CORPORATE BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.39 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 0-3 YEAR U.S. CORPORATE BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.40 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-3 YEAR U.S. TREASURY BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.41 FÜR DEN STATE STREET SPDR FTSE EPRA EUROPE EX UK REAL ESTATE UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.42 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 10+ YEAR U.S. CORPORATE BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.43 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. TIPS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.44 FÜR DEN STATE STREET SPDR MSCI JAPAN UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.45 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 3-7 YEAR U.S. TREASURY BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2025, DEM NACHTRAG NR.47 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 7-10 YEAR U.S. TREASURY BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.48 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 10+ YEAR U.S. TREASURY BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.53 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 10+ YEAR EURO GOVERNMENT BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.54 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-10 YEAR U.S. CORPORATE BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.55 FÜR DEN STATE STREET SPDR MSCI WORLD UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.56 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-3 MONTH T-BILL UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.57 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P 500 LEADERS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.60 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. CORPORATE SCORED UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.61 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.62 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.63 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.65 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 0-3 YEAR EURO CORPORATE UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.66 FÜR DEN STATE STREET SPDR J.P. MORGAN SAUDI ARABIA AGGREGATE BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.67 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P 500 QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.68 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P DEVELOPED QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.69 FÜR DEN STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-5 YEAR U.S. CORPORATE BOND UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.70 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP LEADERS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR. 71 FÜR DEN STATE STREET SPDR S&P EUROPE QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.72 FÜR DEN STATE STREET SAUDI ARABIA ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.73 FÜR DEN STATE STREET GLOBAL DIVIDEND SPOTLIGHT ACTIVE EQUITY UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.74 FÜR DEN STATE STREET WORLD SMALL CAP ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, DEM NACHTRAG NR.75 FÜR DEN STATE STREET ALL WORLD ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF VOM 19. FEBRUAR 2026, UND ZUSÄTZLICHEN INFORMATIONEN FÜR ANLEGER IN DER BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND, GENEHMIGT DURCH DIE IRISCHE ZENTRALBANK AM 24. FEBRUAR 2026.

DIESER KONSOLIDIERTE PROSPEKT STELLT KEINEN PROSPEKT IM SINNE DES GELTENDEN IRISCHEN RECHTS DAR UND DARF NUR IN VERBINDUNG MIT ANLEGERN IN DEUTSCHLAND VERWENDET WERDEN.

Potenzielle Anleger sollten diesen Prospekt und den globalen Nachtrag (zusammen der „**Prospekt**“), die maßgeblichen Nachträge und das entsprechende Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („**PRIIP-KID**“) oder die wesentlichen Anlegerinformationen („**KIID**“) sorgfältig und in ihrer Gesamtheit prüfen, und sich vor einer Entscheidung über eine Anlage in einen Fonds sich bei einem Wertpapiermakler, Bankberater, Rechts-, Steuer- oder sonstigen Finanzberater unabhängig über folgende Punkte informieren: (a) über die gesetzlichen Vorschriften ihres Landes in Bezug auf Kauf, Besitz, Umtausch, Rückgabe und Veräußerung von Anteilen, (b) über bestehende Devisenbeschränkungen ihres Landes in Bezug auf Kauf, Besitz, Umtausch, Rückgabe und Veräußerung von Anteilen, (c) über rechtliche, steuerliche, finanzielle und sonstige Folgen in Zusammenhang mit Zeichnung, Kauf, Halten, Umtausch, Rückgabe oder Veräußerung von Anteilen und (d) über die Bestimmungen dieses Prospekts und des bzw. der maßgeblichen Nachtrags/Nachträge.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

(Eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds nach irischem Recht gegründet wurde und von der Zentralbank gemäß den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 zugelassen wurde.)

PROSPEKT

SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „**Gesellschaft**“) und der Verwaltungsrat der Gesellschaft (der „**Verwaltungsrat**“), deren Namen im Abschnitt „Management“ weiter unten aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Dokument enthaltenen Informationen. Nach bestem Wissen und Gewissen der Gesellschaft und der Verwaltungsratsmitglieder (die alle angemessene Sorgfalt darauf verwendet haben, dies sicherzustellen) stimmen die in diesem Dokument enthaltenen Angaben mit den Tatsachen überein und lassen nichts aus, was die Richtigkeit dieser Angaben berühren könnte. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder übernehmen dementsprechend die Verantwortung.

Der globale Nachtrag ist Teil dieses Prospekts und enthält eine Aufstellung aller Fonds, die derzeit von der Zentralbank genehmigt sind.

Das PRIIPs-KID oder die KIID für die einzelnen Fonds enthalten wichtige Informationen über die Fonds, u.a. auch die jeweiligen synthetischen Risiko-Ertrags-Indikatoren, Gebühren und, sofern zutreffend, die historische Wertentwicklung der jeweiligen Fonds. Jeder Anleger muss vor der Zeichnung von Anteilen eines Fonds bestätigen, dass er das maßgebliche PRIIP-KID oder die KIID erhalten hat. Das PRIIPs-KIDs und die KIID und der letzte Jahresbericht sowie die Halbjahresberichte der Gesellschaft können von der Website heruntergeladen werden.

Anleger sollten sich darüber im Klaren sein, dass der Preis von Anteilen sowohl fallen als auch steigen kann und sie möglicherweise einen Totalverlust ihres eingesetzten Kapitals erleiden können. Die zu einem gegebenen Zeitpunkt bestehende Differenz zwischen dem Zeichnungs- und Rücknahmepreis von Anteilen bedeutet, dass eine Anlage in einen Teilfonds als mittel- bis langfristig betrachtet werden sollte. Risikofaktoren, die jeder Anleger berücksichtigen sollte, sind im Abschnitt „Risikoinformationen“ weiter unten dargelegt. Risikofaktoren, die für die Fonds von besonderer Relevanz sind, werden auch in den jeweiligen Nachträgen beschrieben.

Die Zulassung der Gesellschaft durch die Zentralbank bedeutet nicht, dass die Zentralbank die Gesellschaft unterstützt oder für sie bürgt, und die Zentralbank ist auch nicht für den Inhalt des Prospekts verantwortlich. Die Zulassung der Gesellschaft durch die Zentralbank bedeutet nicht, dass die Zentralbank eine Gewährleistung für die Wertentwicklung der Gesellschaft übernimmt. Die Zentralbank haftet nicht für die Wertentwicklung oder eine Nichtleistung der Gesellschaft.

Anteile werden und dürfen weder direkt noch indirekt in den Vereinigten Staaten von Amerika, deren Territorien oder Besitzungen oder in einem Einzelstaat oder dem District of Columbia (die „**Vereinigten Staaten**“) oder an oder für Rechnung oder zugunsten von US-Personen – gemäß Anhang I zu diesem Prospekt – angeboten, verkauft oder ausgehändigt werden. Die Anteile wurden und werden nicht gemäß dem U.S. Securities Act of 1933 (US-Wertpapiergesetz von 1933), in der jeweils geltenden Fassung, oder gemäß den Wertpapiergesetzen eines Bundesstaates der Vereinigten Staaten registriert, und die Gesellschaft wird nicht gemäß dem U.S. Investment Company Act of 1940 (US-Gesetz über Investmentgesellschaften), in der jeweils geltenden Fassung, registriert. Ein Weiteranbieten oder Weiterverkauf von Anteilen in den Vereinigten Staaten oder an US-Personen kann einen Verstoß gegen US-Recht darstellen.

Anschriftenverzeichnis.....	3
Allgemeine Informationen.....	4
Sonstige Informationen.....	14
Anlagebeschränkungen.....	16
Risikoinformationen	21
Kauf- und Verkaufsinformationen	50
Ausschüttungen.....	59
Gebühren und Kosten	59
Steuerinformationen	61
Management.....	66
Wo erhalten Sie weitere Informationen zu den Fonds?	73
Anhang I – Definitionen	74
Anhang II – Anerkannte Märkte.....	82
Anhang III – Unterdepotbanken	86

Anschriftenverzeichnis

Die Gesellschaft:

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc
78 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Ireland

Verwaltungsgesellschaft, Anlageverwalter und globale Vertriebsstelle:

State Street Global Advisors Europe Limited
78 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Ireland

Verwahrstelle:

State Street Custodial Services (Ireland) Limited
78 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2 Ireland

Gesellschaftssekretär:

Matsack Trust Limited
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Ireland

Rechtsberater in Irland:

Matheson LLP
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Ireland

Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft:

Frau Barbara Healy
Frau Rebecca Bridger
Herr Lim Siong Kwong (Benjamin) Lam
Thuon Mine
Herr Tom Coghlan
Herr Eric Linnane

**Verwaltungsrat der
Verwaltungsgesellschaft**

Herr Nigel Wightman
Frau Ann
Prendergast Herr
Eric Linnane
Herr Scott Sanderson
Dr. Margaret Cullen
Ms Marie-Anne Heeren
Mr Patrick Mulvihill

Verwaltungs- und Registerstelle:

State Street Fund Services (Ireland) Limited
78 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2 Ireland

Wirtschaftspr

üfer: Ernst &
Young EY
Building
Harcourt Centre
2 Harcourt Street,
Dublin 2, D02 YA40,
Irland

Allgemeine Informationen

Dieser Abschnitt ist als Einführung zu diesem Prospekt zu verstehen und Entscheidungen für eine Anlage in den Anteilen sollten auf Basis des gesamten Prospekts, einschließlich der maßgeblichen Nachträge, getroffen werden. Die Bedeutung definierter Begriffe, die in diesem Prospekt verwendet werden, ist Anhang I zu diesem Prospekt zu entnehmen.

Die Gesellschaft

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital, die am 5. Januar 2011 unter der Unternehmensnummer 493329 gegründet wurde, und ist von der Zentralbank als OGAW zugelassen. Das Ziel der Gesellschaft ist die gemeinsame Anlage von auf dem Kapitalmarkt aufgebrachten Geldern in Wertpapieren und/oder anderen liquiden Finanzanlagen nach dem Grundsatz der Risikostreuung gemäß den OGAW-Vorschriften. Die Gesellschaft ist als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung der Teilfonds untereinander strukturiert. Der Verwaltungsrat kann, mit vorheriger Genehmigung der Zentralbank, bisweilen verschiedene Anteilserien auflegen, die unter Einhaltung der Erfordernisse der Zentralbank separate Portfolios mit Vermögenswerten repräsentieren, wobei jede einzelne Serie einen Fonds bildet. Jeder Fonds trägt seine eigenen Verbindlichkeiten, und nach irischem Recht können weder die Gesellschaft oder von der Gesellschaft ernannte Dienstleister oder die Verwaltungsratsmitglieder, Konkursverwalter, Prüfer oder Liquidatoren noch sonstige Personen auf die Vermögenswerte eines Fonds zur Begleichung einer Verbindlichkeit eines anderen Fonds zurückgreifen.

Das für jede Serie von Anteilen geführte und zu einem Fonds gehörende Vermögensportfolio wird gemäß den für diesen Fonds geltenden und im maßgeblichen Nachtrag dargelegten Anlagezielen und der Anlagepolitik investiert. Die verschiedenen Anteile werden entweder als ETF-Anteile (also Anteile, die dafür vorgesehen sind aktiv an einem Sekundärmarkt gehandelt zu werden) oder Nicht-ETF-Anteile (also Anteile, die nicht börsennotiert oder aktiv an einem Sekundärmarkt gehandelt werden) kategorisiert. Anteile können in verschiedene Klassen unterteilt werden, um u.a. die Unterscheidung zwischen ETF-Anteilen und Nicht-ETF-Anteilen, verschiedene Dividendenarrangements, Gebühren- und Kostenarrangements (einschließlich unterschiedlicher Gesamtaufwandsquoten), Währungen oder Absicherungen in anderen Währungen unter Einhaltung der Richtlinien und Erfordernisse der Zentralbank zu ermöglichen.

Anlageziele und Anlagepolitik

Anlageziel und Anlagepolitik eines Fonds. Die Anlageziele, Anlagestrategien und Anlagepolitik für die einzelnen Fonds werden im maßgeblichen Nachtrag dargelegt.

Die Vermögenswerte der einzelnen Fonds werden gemäß den Anlagebeschränkungen in den OGAW-Vorschriften, die weiter unten im Abschnitt „**Anlagebeschränkungen**“ zusammengefasst werden, sowie gemäß den zusätzlichen, ggf. von der Verwaltungsgesellschaft für einen Fonds festgelegten und im maßgeblichen Nachtrag dargelegten Anlagebeschränkungen angelegt. Der Verwaltungsrat kann Fonds errichten, die bestrebt sind einen Index nachzubilden

(„**indexnachbildende Fonds**“) oder einen Index zu übertreffen („**aktiv verwaltete Fonds**“), indem sie:

- ausschließlich in Indexwertpapiere, übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die keine Indexwertpapiere sind, investieren;
- ausschließlich in derivative Finanzinstrumente („**DFI**“) investieren;
- ausschließlich in Anteile zugrunde liegender Fonds investieren, u.a. auch als Feederfonds in einen anderen Fonds, der nach den OGAW-Vorschriften autorisiert ist; oder
- in eine Kombination aus Indexwertpapieren, übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, die keine Indexwertpapiere sind, DFI und Anteilen an zugrunde liegenden Fonds investieren.

Informationen über die Anlageziele und die Arten der Instrumente bzw. Wertpapiere, in die der jeweilige Fonds investiert, sind im maßgeblichen Nachtrag enthalten. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil („**INAV**“) finden Sie auf der Website.

„Wie im maßgeblichen Nachtrag festgelegt wird, gelten die saudischen FIS-Vorschriften für Fonds, die in an der Börse des Königreichs Saudi-Arabien („**KSA**“) notierte Aktien investieren. Diese Vorschriften enthalten Beschränkungen für die Anlage in Aktien, die in Saudi-Arabien notiert sind, durch ausländische Anleger, einschließlich Saudi QFIs. Beschränkungen für ausländisches Eigentum können verhindern, dass der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter in Aktien, die in Saudi-Arabien notiert sind, investiert, oder so lange den Verkauf von Positionen erforderlich machen, bis die Schwellenwerte für ausländisches Eigentum nicht mehr überschritten werden“.

Wie im maßgeblichen Nachtrag festgelegt wird, können diese Anlagen in der VRC wie folgt über ein Zugangsprogramm/Zugangsprogramme getätigt werden:

- (i) direkt am heimischen Wertpapiermarkt in der VRC (in chinesischen A-Aktien und sonstigen heimischen Wertpapieren, inklusive sonstiger zulässiger Aktien und Anleihen) unter Verwendung des lizenzierten QFI-Status des Anlageverwalters.
- (ii) über Stock Connect (wie im maßgeblichen Nachtrag beschrieben, kann der Anlageverwalter das Anlageziel eines entsprechenden Fonds verfolgen, indem er bis zu 100 % des Nettoinventarwerts des Fonds über Stock Connect direkt in chinesische A-Aktien investiert);
- (iii) über das/die CIBM Direct Access Programme(s) (CIBM-Direktzugangsprogramm(e)); und/oder
- (iv) über Bond Connect.

Nachstehend folgen weitere Angaben zu den einzelnen Zugangsprogrammen.

Das QFI-Regime ist eine politische Initiative Chinas, die es Inhabern einer QFI-Lizenz ermöglicht, vorbehaltlich in der VRC geltender regulatorischer Anforderungen Mittel, die außerhalb der VRC aufgenommen wurden, in die

chinesischen Wertpapiermärkte zur dortigen Anlage zu leiten. Da die Fonds die Qualifikationskriterien für den QFI-Status nicht selbst erfüllen, erfolgen die Direktanlagen über die Inhaber von QFI-Lizenzen wie den Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter. Das QFI-Regime wird gemeinsam von CSRC, SAFE und PBoC unter verschiedenen Gesichtspunkten geregelt. Ihre jeweiligen Pflichten und Befugnisse sind nachstehend zusammengefasst:

Die chinesische Wertpapieraufsichtsbehörde CSRC

- a) genehmigt die Lizenzanträge potenzieller internationaler Investoren; und
- b) überwacht und reguliert gemeinsam mit der PBoC die Anlagen von QFI in chinesische Wertpapiere und Futures.

Die chinesische Zentralbank PBoC und die chinesische Devisenaufsichtsbehörde SAFE

- a) überwachen und regulieren die Bankkonten von QFIs in China;
- b) überwachen und regulieren grenzüberschreitende Überweisungen; und
- c) überwachen und regulieren alle Belange der Währungsumrechnung.

Das SHHK Stock Connect ist ein Wertpapierhandels- und Clearing-Programm, das seit dem 17. November 2014 in Betrieb ist und von SEHK, SSE, HKSCC und CSDCC mit dem Ziel entwickelt wurde, einen gegenseitigen Aktienmarktzugang zwischen dem chinesischen Festland (Schanghai) und Hongkong zu schaffen. SZHK Stock Connect ist ein ähnliches Wertpapierhandels- und Clearing-Programm, das von der SEHK, SZSE, HKSCC und CSDCC entwickelt wurde, um einen gegenseitigen Aktienmarktzugang zwischen dem chinesischen Festland (Shenzen) und Hongkong zu schaffen. Das SZHK Stock Connect ist seit 5. Dezember 2016 in Betrieb. SSE, SZSE und SEHK ermöglichen es Fonds, qualifizierte Aktien, die jeweils am Markt des anderen notiert sind, über lokale Wertpapierunternehmen oder Makler zu handeln, vorbehaltlich der jeweils geltenden Regeln und Bestimmungen.

Der CIBM ist der außerbörsliche Interbankenmarkt für Anleihen neben den beiden Hauptbörsen (SSE und SZSE), der 1997 eingerichtet wurde. Der CIBM und seine Marktteilnehmer werden von der PBoC reguliert. Der CIBM ist der Haupthandelsplatz für Anleihen in der VRC. Die CFETS ist die offizielle Handelsplattform des CIBM. Die CFETS betreibt ihre Handelsplattform mit umfassenden Funktionen für Trade Matching, Post-Trade-Services und Informationsdienste. CCDC und SHCH wurden als Zentralverwahrer der am CIBM gehandelten Anleihen benannt; sie registrieren, halten und verwahren die Anleihen in Form von Buchungen und nehmen Zins- und Tilgungszahlungen für die Anleger vor. Die Handelsplattform der CFETS ist direkt mit dem Centralised Bond Book Entry System der CCDC und der SHCH verbunden, um ein Straight Through Processing des Handels und der Abrechnung von Anleihen auf dem CIBM zu erreichen. Gemäß den Vorschriften der VRC sind einige qualifizierte ausländische Anleger berechtigt, an dem bzw. den CIBM Direct Access Programme(s) teilzunehmen, um Investitionen am CIBM zu tätigen. Der Anlageverwalter hat

sich im Namen eines jeden betreffenden Fonds als qualifiziertes Institut im Rahmen des bzw. der CIBM Direct Access Programme(s) über einen Handels- und Abrechnungsvertreter für den Onshore-Anleihenhandel am Interbankenmarkt, der für die Einreichung der entsprechenden Anträge und die Kontoeröffnung bei den zuständigen chinesischen Behörden zuständig ist, registriert.

Bond Connect ist eine am 3. Juli 2017 gestartete Initiative, die Festlandchina und Hongkong wechselseitigen Zugang zum Anleihenmarkt gibt, von CFETS, CCDC, SHCH, HKEx und CMU eingerichtet wurde und Anlagen auf dem CIBM über eine Vereinbarung zwischen Festlandchina und Hongkong zulässt, die es chinesischen und ausländischen Anlegern ermöglicht, verschiedene Schuldtitelgattungen auf den Anleihenmärkten der jeweils anderen Partei über eine Verbindung zwischen den jeweiligen Instituten der Finanzinfrastruktur zu handeln.

Anleger sollten sich darüber im Klaren sein, dass die Nutzung des Zugangsprogramms bzw. der Zugangsprogramme den Fonds erhöhten Risiken aussetzt. Anleger sollten auch die Risikowarnungen unter den Überschriften „**Risiken im Zusammenhang mit der Volksrepublik China und Großchina**“, „**Risiken im Zusammenhang mit Anlagen über Zugangsprogramme**“ und „**Risiken im Zusammenhang mit der Besteuerung in der VRC**“ im Abschnitt „**Risikoinformationen**“ lesen.

Indexnachbildende Fonds

Indexnachbildende Fonds sind bestrebt, die Wertentwicklung eines Index nachzubilden und gleichzeitig die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der seines jeweiligen Index so gering wie möglich zu halten. Einige Fonds sind bestrebt, dieses Ziel über eine Replikationsstrategie, eine Optimierungsstrategie, eine Strategie stratifizierter Stichproben, eine synthetische Nachbildungsstrategie oder eine andere Strategie, die als die vom Anlageverwalter für den jeweiligen Fonds als am besten geeignete Strategie erachtet wird, zu erreichen. Der maßgebliche Nachtrag erläutert und beschreibt die Strategie, die der jeweilige Fonds anwendet, und enthält Einzelheiten darüber, wo Informationen über den Index, der von dem Fonds nachgebildet wird, erhältlich sind.

Es folgt eine kurze Zusammenfassung der Nachbildungsstrategie, der Optimierungsstrategie, der Strategie stratifizierter Stichproben und der synthetischen Nachbildungsstrategie. Detaillierte Informationen zu den jeweiligen Strategien sind im maßgeblichen Nachtrag enthalten.

- **Nachbildungsstrategie** – diese Strategie zielt darauf ab, alle oder nahezu alle Wertpapiere des jeweiligen Index annähernd in denselben Gewichtungen wie in diesem Index physisch zu halten. Im Prinzip ist das Portfolio des Fonds fast ein Spiegelbild des jeweiligen Index
- **Optimierungsstrategie** – diese Strategie zielt darauf ab, ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das den Risiko- und Renditemerkmalen des anwendbaren Index entspricht, einschließlich Risiken im Zusammenhang mit Währungen, Ländern, Sektoren, Branchen und Größe. Die Optimierungsstrategie wird in aller Regel

- **Strategie stratifizierter Stichproben** – Diese Strategie zielt darauf ab, ein repräsentatives Portfolio aufzubauen, das möglichst kostengünstig den Risiko- und Renditemerkmalen des Index entspricht, insbesondere Risiken im Zusammenhang mit Währungen, Ländern, Sektoren, Qualität, Laufzeit, Duration und Emittenten. Stratifizierte Stichproben werden in aller Regel eingesetzt, weil der Index zu viele Wertpapiere enthält, als dass sie effizient gekauft werden könnten, und mitunter bestimmte im Index enthaltene Wertpapiere auf dem offenen Markt schwer oder zu hohen Kosten erhältlich sein können. Somit hält ein Fonds, der diese Strategie anwendet, in der Regel nur eine Teilmenge der im Index enthaltenen Wertpapiere.
- **Synthetische Nachbildungsstrategie** – Diese Strategie strebt die Nachbildung der Wertentwicklung eines Index an, indem sie derivative Finanzkontrakte wie etwa Total Return Swaps mit einem oder mehreren Kontrahenten eingeht. Statt die zugrunde liegenden Wertpapiere des Index direkt zu halten, erhält der Fonds die wirtschaftliche Performance des Index über diese derivativen Instrumente. Dieser Ansatz kann verwendet werden, wenn eine Direktanlage in die Indexkomponenten aufgrund von Beschränkungen des Marktzugangs, Liquiditätsengpässen oder Kostenerwägungen undurchführbar oder ineffizient ist. Der maßgebliche Nachtrag erläutert und beschreibt die Nutzung der synthetischen Nachbildung und enthält Einzelheiten zu den Kontrahenten und den eingesetzten Maßnahmen zur Risikominderung.

Veränderungen in der Zusammensetzung und/oder Gewichtung der Wertpapiere in dem Index, den ein Fonds nachbildet, erfordern normalerweise entsprechende Anpassungen oder Neuausrichtungen (Rebalancing) der Fondsanlagen, um den Index weiter nachbilden zu können. Der Anlageverwalter wird dementsprechend versuchen, die Zusammensetzung und/oder Gewichtung der Wertpapiere, die von einem Fonds zum jeweiligen Zeitpunkt gehalten werden oder in denen er ein Engagement aufgebaut hat, soweit sinnvoll, neu auszurichten, so dass den Änderungen in der Zusammensetzung und/oder Gewichtung des Index Rechnung getragen wird. Ein Fonds kann mitunter auch Wertpapiere halten oder ein Engagement in ihnen aufbauen, die nicht in seinem Index enthalten sind, wenn der Anlageverwalter dies angesichts von Anlageziel und Anlagebeschränkungen des Fonds – oder anderer Faktoren – für angebracht hält. Ob der Fonds solche vorgeschlagenen Anlagen vornehmen kann, wird im maßgeblichen Nachtrag angegeben. Andere Maßnahmen zur Neuausrichtung können von Zeit zu Zeit durchgeführt werden, um sicherzustellen, dass die Übereinstimmung der Wertentwicklung eines Fonds mit der Wertentwicklung des Index aufrechterhalten wird. Die Risikohinweise unter der Überschrift „**Indexnachbildungsrisiko**“ im Abschnitt „**Risikoinformationen**“ enthalten weitere Einzelheiten zu Faktoren, die die Fähigkeit des Fonds einschränken können, die Wertentwicklung eines Index nachzubilden. Informationen über die erwartete Höhe des Tracking Errors in Bezug auf einen Fonds sind im maßgeblichen Nachtrag enthalten. Näheres über die tatsächliche Höhe des von einem Fonds verzeichneten Tracking Errors ist im letzten Abschluss der Gesellschaft enthalten.

Der Anlageverwalter verlässt sich im Hinblick auf Informationen über die Zusammensetzung und/oder Gewichtung der Wertpapiere, die diesen Index bilden (die „**Indexwertpapiere**“) allein auf den Indexanbieter. Ist es dem Anlageverwalter nicht möglich, an einem Geschäftstag diese Informationen bezüglich eines Index einzuholen oder zu verarbeiten, wird zum Zwecke aller Anpassungen die zuletzt veröffentlichte Zusammensetzung und/oder Gewichtung dieses Index herangezogen.

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft gemäß den Anforderungen von Verordnung (EU) 2016/1011 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 8. Juni 2016 über Indizes, die bei Finanzinstrumenten und Finanzkontrakten als Referenzwert oder zur Messung der Wertentwicklung eines Investmentfonds verwendet werden, (die „**Benchmark-Verordnung**“) einen Benchmark-Notfallplan ausgearbeitet hat, der die Maßnahmen vorsieht, die die Gesellschaft ergreift, wenn eine von einem Fonds herangezogene Benchmark wesentlich verändert oder nicht mehr bereitgestellt wird (der „**Benchmark-Notfallplan**“). Von der Gesellschaft auf der Grundlage des Benchmark-Notfallplans ergriffene Maßnahmen können zu Änderungen an den Anlagezielen oder der Anlagepolitik eines Fonds führen, und solche Änderungen werden gemäß den Anforderungen der Zentralbank und den Bestimmungen dieses Prospekts umgesetzt.

Die Anlagen eines aktiv verwalteten Fonds werden vom Anlageverwalter oder von dessen Beauftragen mit dem Ziel, das Anlageziel zu erreichen (zum Beispiel einen Index zu übertreffen) anstatt ihn einfach nur nachzubilden, aktiv verwaltet. Wird ein Fonds aktiv verwaltet, verfügt der

Währungsabsicherung auf Anteilklassenebene. Ein Fonds kann für eine bestimmte Klasse derivative Finanzinstrumente einsetzen, unter anderem Devisenterminkontrakte, um das Währungsrisiko für diese Klasse ganz oder teilweise abzusichern. Werden in einem Fonds auf verschiedene Währungen lautende Klassen aufgelegt und Transaktionen zur Währungsabsicherung vorgenommen, um ein maßgebliches Währungsengagement abzusichern, ist jede solche Transaktion eindeutig der bestimmten Klasse zuzuordnen und gehen entstehende Kosten ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Entsprechend schlagen sich sämtliche solchen Kosten und darauf bezogene Verbindlichkeiten und/oder Vorteile im Nettoinventarwert je Anteil einer solchen Klasse nieder. Über- oder unterbesicherte Positionen können unbeabsichtigt aufgrund von Faktoren entstehen, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters entziehen, doch der Anlageverwalter stellt sicher, dass überbesicherte Positionen 105 % des Nettoinventarwerts der betreffenden Klasse nicht überschreiten bzw. unterbesicherte Positionen 95 % des Anteils am Nettoinventarwert der betreffenden Klasse, der gegen Währungsrisiken abgesichert werden soll, nicht unterschreiten. Der Anlageverwalter überwacht die Absicherung, und diese Überwachung beinhaltet auch ein Verfahren, mit dem sichergestellt wird, dass Positionen, die 100 % wesentlich überschreiten, nicht Monat für Monat fortgeschrieben werden. Soweit diese Absicherung erfolgreich ist, wird sich die Performance der betreffenden Anteilsklasse wahrscheinlich entsprechend der Performance der Basiswerte entwickeln. Der Einsatz abgesicherter Anteilsklassen kann dazu führen, dass Inhaber von Anteilen der jeweiligen Klasse nur sehr begrenzt davon profitieren, wenn sich die Klassenwährung gegenüber der Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, ungünstig entwickelt.

Die Verwaltungsgesellschaft kann in ihrem alleinigen Ermessen beschließen, den bestehenden Index eines Fonds zu ändern oder zu ersetzen, wenn er der Meinung ist, dass dies im besten Interesse eines Fonds ist. Die Verwaltungsgesellschaft kann beispielsweise einen solchen Index unter folgenden Umständen ersetzen:

- Die obige Aufzählung ist unverbindlich und erhebt keinen Anspruch auf Vollständigkeit in Hinblick auf die Möglichkeiten der Verwaltungsgesellschaft, den Index nach eigenem Ermessen auch unter anderem Umständen zu ändern. Der Prospekt und alle maßgeblichen Nachträge werden im Falle eines Wechsels oder einer Änderung des bestehenden Index eines Fonds in einen anderen Index aktualisiert.

Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds für Anlagezwecke oder für Zwecke des effizienten Portfoliomanagements wird im maßgeblichen Nachtrag beschrieben. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet die Reduzierung von Risiken, einschließlich des Risikos von Nachbildungsfehlern (Tracking Error) zwischen der Wertentwicklung eines Fonds und der Wertentwicklung eines Index, der vom betreffenden

Fonds nachgebildet wird, die Senkung von Kosten der Gesellschaft, die Generierung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für die Gesellschaft und die Absicherung gegen Marktbewegungen, Wechselkursrisiken oder Zinsänderungsrisiken, vorbehaltlich der im nachstehenden Abschnitt „Anlagebeschränkungen“ beschriebenen allgemeinen Beschränkungen. Hedging ist eine Technik, die angewandt wird, um ein Risiko aus einer Basisposition zu minimieren, indem dem Risiko durch Erwerb einer Ausgleichsposition entgegengewirkt wird. Die für Absicherungszwecke eingegangenen Positionen dürfen den Wert der Vermögenswerte, für die ein Ausgleich geschaffen werden soll, nicht wesentlich überschreiten. In dem Maße, wie ein Fonds DFI einsetzt, kann das Risiko einer erhöhten Volatilität des Nettoinventarwerts des Fonds bestehen. Werden DFI von einem Fonds an einer Börse gehandelt, müssen diese Börsen ebenfalls anerkannte Märkte sein.

Nachfolgend finden Sie eine zusammenfassende Beschreibung der einzelnen Arten von DFI, die für Anlagezwecke oder ein effizientes Portfoliomanagement von einem Fonds genutzt werden können. Weitere Informationen über die von dem jeweiligen Fonds eingesetzten DFI sind in dem maßgeblichen Nachtrag enthalten.

- **Futures** — Terminkontrakte sind Vereinbarungen, eine festgelegte Menge eines Index, einer Aktie, Anleihe oder Währung zu einem festgelegten Datum in der Zukunft zu kaufen oder zu verkaufen. Terminkontrakte (Futures) sind börsengehandelte Instrumente, und ihr Handel unterliegt den Bestimmungen der Börsen, an denen sie gehandelt werden.
- **Devisenterminkontrakte** — Devisenterminkontrakte sind Verträge zwischen Parteien über den Austausch einer bestimmten Geldmenge unterschiedlicher Währungen zu einem vereinbarten Wechselkurs zu einem vereinbarten Zeitpunkt in der Zukunft. Devisenterminkontrakte ähneln Devisen-Futures. Sie werden aber nicht börsengehandelt, sondern sind stattdessen im Freiverkehr gehandelte Instrumente. Devisenterminkontrakte können zum Beispiel dazu genutzt werden, um Währungsrisiken im Index zu steuern. Non-Deliverable-Devisenterminkontrakte dürfen aus denselben Gründen eingesetzt werden. Sie weichen dahingehend von Standard-Devisenterminkontrakten ab, dass mindestens eine der Währungen in der Transaktion bei der Abrechnung eines aus der Transaktion resultierenden Gewinns oder Verlusts nicht geliefert werden darf. Gewinne oder Verluste werden in diesem Fall typischerweise in US-Dollar oder Euro geliefert.
- **Optionsscheine** — Optionsscheine gewähren das Recht, ein zugrunde liegendes Wertpapier zu einem festen Preis vom Emittenten zu erwerben (dies unterscheidet sich von einer Option, bei der, wie weiter unten beschrieben, ein Dritter ein Recht zum Erwerb eines zugrunde liegenden Wertpapiers erwirbt). Ein Fonds kann Optionsscheine für Wertpapiere als Ersatz für eine Position in dem jeweiligen

zugrunde liegenden Wertpapier halten und/oder um innerhalb der von der Zentralbank festgelegten Grenzen ein Engagement einzugehen.

- **Optionen** — Optionen sind Kontrakte, über die der Aussteller (Verkäufer) sich verpflichtet, dass der Käufer des Kontrakts das Recht - aber nicht die Pflicht - hat, einen bestimmten Index-, Aktien-, Anleihen- oder Devisenwert zu einem bestimmten Preis (dem Basispreis) an oder vor Ablauf eines bestimmten Verfallstags oder Ausübungsstichtags zu kaufen oder zu verkaufen. Eine Option, die dem Käufer das Recht zum Kauf zu einem bestimmten Kurs verleiht, wird Kaufoption oder engl. „Call“ genannt. Eine Option, die ihm das Recht zum Verkauf verleiht, wird Verkaufsoption oder engl. „Put“ genannt. Der Fonds kann Kauf- und Verkaufsoptionen für Wertpapiere (einschließlich Straddles), Wertpapierindizes und Währungen erwerben und ausgeben und er darf Optionen für Terminkontrakte (einschließlich Straddles) und Swap-Vereinbarungen einsetzen und/oder sie zur Absicherung gegen Veränderungen von Zinsen, Wechselkursen oder Wertpapierkursen nutzen. Ein Teilfonds kann auch Optionen als Ersatz für das direkte Engagement in anderen Wertpapieren und Fonds und/oder zur Erlangung eines Engagements innerhalb der durch die Zentralbank festgelegten Grenzen abschließen.

Bitte lesen Sie den nachfolgenden Abschnitt „Sicherheitsleistungen“, um mehr über die Politik der Gesellschaft in Hinsicht auf Sicherheitsleistungen, die unter DFI entgegengenommen werden, zu erfahren.

Einsatz von TBA-Wertpapieren. Der Einsatz von hypotheckenbesicherten Wertpapieren durch „To Be Announced“ („TBA“)-Wertpapiere durch einen Fonds wird im maßgeblichen Nachtrag beschrieben. MBS-Anleihen auf TBA-Basis sind typischerweise Schuldtitel, die durch Agenturen wie die Federal National Mortgage Association (Fannie Mae), die Federal Home Loan Mortgage Corporation (Freddie Mac) etc. strukturiert werden. Bei einer typischen TBA-Transaktionen werden die Konditionen des Wertpapiers, wie Kupon, Nennwert, Preis und Abrechnungsdatum zum Zeitpunkt der Transaktion festgelegt, aber die eigentliche Lieferung muss erst zu einem späteren Zeitpunkt erfolgen, und TBA-MBS werden in der Regel an einem bestimmten Datum in jedem Kalendermonat glattgestellt. So kann der Fonds z.B. eine Transaktion zum Kauf einer TBA-MBS eingehen, bei der der Emittent für einen Zeitraum von beispielsweise drei Monaten nicht verpflichtet ist, das Wertpapier an den Fonds zu liefern. In der Regel wird der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter MBS-Anleihen auf TBA-Basis unmittelbar vor dem erwarteten Glattstellungsdatum verkaufen und auf diese Weise etwaige Gewinne aus dem Kauf und Verkauf der TBA-MBS auf TBA-Basis realisieren. Entsprechend kann ein Fonds TBA-MBS einsetzen, um sich im Hypothekensektor zu engagieren, ohne der Verpflichtung zu unterliegen, die betreffenden Wertpapiere entgegenzunehmen. Ein Fonds kann TBA-MBS einsetzen, um ein liquides Engagement in der Komponente des Index zu erzielen, die MBS-Anleihen aus den USA umfasst, mit

dem Ziel, den Tracking Error zwischen dem Fonds und dem Index zu minimieren.

Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen. Die Gesellschaft kann, vorbehaltlich der Bedingungen und Beschränkungen, die in den OGAW-Vorschriften der Zentralbank aufgeführt sind, Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und Vereinbarungen über Wertpapierleihgeschäfte abschließen. Für Zwecke des effizienten Portfoliomanagements können Pensionsgeschäfte und Wertpapierleihverträge eingesetzt werden. Anleger sollten den maßgeblichen Nachtrag lesen, um herauszufinden, ob ein Fonds diese Techniken einsetzt, und um Einzelheiten zu den Kosten und/oder den Erlösen, die mit ihnen verbunden sind, und die Identität der Gesellschaften, die diese erhalten, zu erfahren. Ein Pensionsgeschäft ist eine Vereinbarung zwischen einem Käufer und einem Verkäufer spezifizierter Wertpapiere, unter der der Verkäufer sich verpflichtet, Wertpapiere zu einem vereinbarten Preis und, in der Regel, zu einem vereinbarten Zeitpunkt zurückzukaufen. Wenn die Gesellschaft der Verkäufer ist, wird die Vereinbarung von der Gesellschaft als Pensionsgeschäft kategorisiert. Wenn die Gesellschaft der Käufer ist, wird die Vereinbarung von der Gesellschaft als umgekehrtes Pensionsgeschäft kategorisiert. Die Differenz zwischen dem Kaufpreis und dem Rückkaufpreis stellt die Rendite des Käufers aus dem Pensionsgeschäft dar. Wenn der Fonds ein umgekehrtes Pensionsgeschäft eingeht, sollte er sicherstellen, dass er jederzeit den vollen Betrag der Barmittel zurückfordern oder das umgekehrte Pensionsgeschäft kündigen kann, entweder plus aufgelaufener Zinsen oder zum aktuellen Marktwert. Sind die Barmittel jederzeit auf Basis des aktuellen Marktwerts abrufbar, sollte der aktuelle Marktwert des umgekehrten Pensionsgeschäfts zwecks Berechnung des Nettoinventarwerts des betreffenden Fonds benutzt werden.

Bei einem Wertpapierleihgeschäft dagegen verleiht der Verleiher Wertpapiere an den Entleiher zu Bedingungen, wonach der Entleiher innerhalb eines festgelegten Zeitraums äquivalente Wertpapiere an den Verleiher zurückgeben muss und der Entleiher an den Verleiher für die Benutzung der verliehenen Wertpapiere in diesem Zeitraum eine Gebühr zahlt. Der Teilfonds sollte sicherstellen, dass er jederzeit entlehnte Wertpapiere zurückfordern kann oder von ihm eingegangene Wertpapierleihgeschäfte kündigen kann. Jeder Fonds kann im Rahmen eines Wertpapierleihprogramms über einen hierzu bestellten Lending Agent, wie z.B. die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, und ihre Konzerngesellschaften, die Wertpapiere in seinem Portfolio an Makler, Händler und andere Finanzinstitute, die für Transaktionen oder für andere Zwecke Wertpapiere leihen möchten, verleihen. Anleger sollten die Risikowarnung unter der Überschrift **„Risiko aus Interessenkonflikten“** im Abschnitt **„Informationen zu Risiken“** für weitere Informationen zu den Risiken im Zusammenhang mit der Zusammenarbeit der Gesellschaft mit verbundenen Unternehmen zur Bereitstellung von Vermittlertätigkeiten im Wertpapierleihgeschäft lesen.

Am 1. Februar 2022 wurden durch die Verordnung (EU) Nr. 909/2014 („**CSDR**“) neue Regeln eingeführt, um die Zahl der gescheiterten Abwicklungen zu verringern und gegen gescheiterte Abwicklungen vorzugehen, wenn sie bei Zentralverwahrern innerhalb der EU auftreten. Zu diesen

Maßnahmen gehört die Einführung von neuen Regelungen für Geldbußen. Diese besagen, dass der für eine gescheiterte Abwicklung verantwortliche Teilnehmer innerhalb des betreffenden Clearingsystems eine Geldbuße zahlen muss, die wiederum an den anderen Teilnehmer ausgeschüttet wird.

Solche Geldbußen, die sich auf Wertpapierleihgeschäfte beziehen, werden vollständig von dem Vermittler für Wertpapierleihen getragen. Sie werden nicht aus dem Vermögen des Fonds gezahlt, in dessen Namen das betreffende, vom Geltungsbereich der Verordnung erfasste Geschäft abgeschlossen wurde. Ein Wertpapierleihgeschäft kann infolge der CSDR-Regeln zur Abwicklungsdisziplin auch dazu führen, dass Geldbußen von dem Vermittler für Wertpapierleihen einbehalten und nicht an den betreffenden Fonds weitergeleitet werden.

Die Teilnahme an einem Wertpapierleihprogramm ermöglicht es einem Fonds, Nettoerlöse aus dem Verleih seiner Wertpapiere zu erzielen. Sämtliche Erträge aus Techniken eines effizienten Portfoliomanagements und der Wertpapierleihe fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich der an den Wertpapierleihvermittler gezahlten Gebühr) an den betreffenden Fonds zurück. Gemäß den Bedingungen des maßgeblichen Wertpapierleihvertrags ist der beauftragte Wertpapierleihvermittler (State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, oder verbundene Unternehmen) berechtigt, einen Teil der Bruttoerträge (bis zu 25 %) aus der Wertpapierleihe einzubehalten, um alle mit dem Wertpapierleihgeschäft verbundenen Gebühren und Kosten zu decken, u. a. für die Lieferung von Darlehen, die Verwaltung von Sicherheiten und die Bereitstellung der Schadloshaltung für die Wertpapierleihe, und diese Gebühren werden zu handelsüblichen Sätzen gezahlt. Der Fonds hat Anspruch auf mindestens 75 % der Bruttoerträge aus der Wertpapierleihe. Informationen zu den direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, die für jeden Fonds in diesem Zusammenhang anfallen, sowie die Identität der Unternehmen, an die diese Kosten und Gebühren gezahlt werden – und gegebenenfalls deren Verbindung zur Verwahrstelle oder der Verwaltungsgesellschaft – werden im Jahresbericht offengelegt. Die Wertpapierleihvereinbarungen und die mit der Wertpapierleihe verbundenen Kosten werden mindestens einmal jährlich überprüft. Der Wertpapierleihvermittler (d. h. die State Street Bank and Trust Company) ist eine nahestehende Partei der Verwaltungsgesellschaft. Anleger sollten auch die Risikohinweise unter der Überschrift **„Risiko der Wertpapierleihe“** im Abschnitt **„Risikoinformationen“** lesen.

Ein Fonds darf Engagements in Wertpapierleihgeschäften, Pensionsgeschäften und umgekehrte Pensionsgeschäften nur mit Kontrahenten eingehen, die in der Regel in OECD-Ländern ansässige Einrichtungen mit Rechtspersönlichkeit sind (und dem Anlageverwalter, der Verwahrstelle oder ihren Beauftragten nahe stehende Parteien sein können) und den Anforderungen der OGAW-Vorschriften der Zentralbank genügen, und erst nach Durchführung einer Bonitätsprüfung. Liegt für den Kontrahenten ein Bonitäts-Rating von einer Rating-Agentur vor, die bei der European Securities and Markets Authority registriert ist und unter deren Aufsicht steht, wird dieses Rating bei der Bonitätsprüfung berücksichtigt. Wird ein Kontrahent durch eine solche Rating-Agentur auf A2 oder darunter (oder ein vergleichbares Rating) herabgestuft, wird für diesen Kontrahenten unverzüglich eine neue Bonitätsprüfung

vorgenommen. Der Einsatz der oben beschriebenen Techniken eines effizienten Portfoliomanagements könnte die Liquidität des Portfolios eines Fonds nachteilig beeinflussen und wird vom Anlageverwalter bei der Steuerung des Liquiditätsrisikos des Fonds berücksichtigt, und diesbezüglich sollten Anleger auch die Risikohinweise unter der Überschrift „**Liquiditätsrisiko**“ im Abschnitt „**Risikoinformationen**“ lesen.

Sicherheiten. Ein Fonds kann Vereinbarungen über Wertpapierleihgeschäfte, Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte nur eingehen, wenn er in Übereinstimmung mit den üblichen Marktpraktiken und im besten Interesse der Gesellschaft handelt und unter der Voraussetzung, dass alle unter dem Wertpapierleihgeschäft, dem Pensionsgeschäft oder dem umgekehrten Pensionsgeschäft (und unter DFI) entgegengenommenen Sicherheitsleistungen jederzeit die folgenden Kriterien erfüllen:

- **Liquidität.** Sicherheiten müssen Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente (beliebiger Laufzeit) sein, die hoch liquide sind und auf einem geregelten Markt oder in einem multilateralen Handelssystem mit transparenter Preisbildung gehandelt werden, damit sie schnell zu einem Preis verkauft werden können, der annähernd ihrer Bewertung vor dem Verkauf entspricht. Sicherheiten müssen den Bestimmungen von Vorschrift 74 der OGAW-Vorschriften entsprechen und sind im Einklang mit den Bestimmungen dieses Prospekts und der OGAW-Vorschriften zu verwenden.
- **Bewertung.** Sicherheiten müssen täglich bewertet werden, und Vermögenswerte, die eine hohe Preisvolatilität aufweisen, dürfen nur mit angemessen konservativen Sicherheitsabschlägen angenommen werden. Sicherheiten können täglich vom Kontrahenten anhand seiner Verfahren, vorbehaltlich etwaiger vereinbarter Abschlüsse, zum Marktwert bewertet werden, um Marktwerten und Liquiditätsrisiken Rechnung zu tragen. Sie können täglichen Nachschussforderungen unterliegen.
- **Emittentenbonität.** Sicherheiten sollten von hoher Qualität sein. Für den Fall, dass eine oder mehrere Ratingagenturen, die von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde („**ESMA**“) zugelassen sind und beaufsichtigt werden, ein Rating für einen Emittenten erteilt hat/haben, muss ein Fonds sicherstellen, dass der für den Fonds eingesetzte Prozess zur Bewertung der Kreditqualität unter anderem auf diese Ratings Bezug nimmt. Es besteht zwar keine mechanische Abhängigkeit von solchen externen Ratings, doch wenn eine Herabstufung unter die beiden höchsten kurzfristigen Kreditratings durch eine von der ESMA zugelassene und beaufsichtigte Agentur, die den Emittenten bewertet hat, erfolgt, so muss das eine Neubewertung der Kreditqualität des Emittenten nach sich ziehen, um sicherzustellen, dass die Sicherheit weiterhin von hoher Qualität ist.
- **Korrelation.** Sicherheiten müssen von einem

Unternehmen emittiert sein, das vom Kontrahenten unabhängig ist und voraussichtlich keine hohe Korrelation mit der Wertentwicklung des Kontrahenten aufweisen wird.

- **Diversifizierung.** Sicherheiten sollten in Bezug auf Länder, Märkte und Emittenten ausreichend gestreut sein. Sachsicherheiten gelten als ausreichend diversifiziert, wenn der betreffende Fonds von einem Kontrahenten einen Korb von Sicherheiten erhält, in dem das Risiko gegenüber einem einzelnen Emittenten 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigt. Wenn der Fonds dem Risiko mehrerer Kontrahenten ausgesetzt ist, werden die verschiedenen Körbe von Sicherheiten zusammengerechnet, um sicherzustellen, dass das Risiko gegenüber einem einzelnen Emittenten 20 % des Nettoinventarwert des Fonds nicht übersteigt.

Unbeschadet des Vorstehenden kann ein Fonds voll abgesichert in verschiedenen Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten sein, die von einem EU-Mitgliedstaat oder einer oder mehreren seiner Gebietskörperschaften, einem Drittstaat oder einer internationalen öffentlich-rechtlichen Organisation, der ein oder mehrere EU-Mitgliedstaaten angehören, begeben oder garantiert werden, wie im Abschnitt „Anlagebeschränkungen“ im Prospekt beschrieben. Solch ein Fonds nimmt Wertpapiere aus mindestens sechs verschiedenen Emissionen entgegen, und Wertpapiere aus einer einzelnen Emission dürfen 30 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigen.

- **Sie müssen sofort verfügbar sein.** Vermögenswerte, die als Sicherheitsleistungen entgegengenommen werden, müssen sich von der Gesellschaft jederzeit ohne Bezugnahme auf oder Genehmigung des Kontrahenten in vollem Umfang vollstrecken lassen.

Es wird nahe gelegt, dass die Fonds die folgenden Arten von Sicherheitsleistungen akzeptieren:

- Staats- oder andere öffentliche Anleihen; und
- Aktien, die an einer Wertpapierbörse im EWR, in der Schweiz, in Kanada, in Japan, im Vereinigten Königreich, in den Vereinigten Staaten, auf Jersey, auf Guernsey, auf der Isle of Man, in Australien, in Neuseeland, Hongkong oder Singapur gehandelt werden.

Die Verwaltungsgesellschaft hat eine Politik für Sicherheitsabschläge in Bezug auf jede Kategorie von Vermögenswerten etabliert, die als Sicherheiten hereingenommen werden. Diese Politik berücksichtigt die Charakteristika der jeweiligen Kategorie von Vermögenswerten, einschließlich der Bonität des Emittenten der Sicherheiten, der Preisvolatilität der Sicherheiten und der Ergebnisse von Stresstests, die gemäß der Stresstestpolitik durchgeführt werden können. Der Wert der Sicherheiten, angepasst angesichts der Politik für Sicherheitsabschläge, muss jederzeit mindestens der Höhe des jeweiligen Kontrahentenrisikos entsprechen.

Bis zum Erlöschen des Pensionsgeschäfts, des umgekehrten Pensionsgeschäfts oder des Wertpapierleihgeschäfts müssen Sicherheitsleistungen, die unter den jeweiligen Vereinbarungen gestellt werden: (a)

täglich zum Marktwert bewertet werden (wie vom Kontrahenten anhand seiner Verfahren bewertet, vorbehaltlich etwaiger vereinbarter Abschläge, um Marktwerten und Liquiditätsrisiken Rechnung zu tragen); und (b) jederzeit dem Wert des investierten Betrags bzw. der verliehenen Wertpapiere entsprechen oder diesen übersteigen.

Sicherheitsleistungen müssen von der Verwahrstelle oder ihrem Handlungsbevollmächtigten (sofern eine Eigentumsübertragung erfolgt) verwahrt werden. Dies gilt nicht für den Fall, dass keine Eigentumsübertragung erfolgt. In diesem Fall kann die Sicherheitsleistung von einer dritten Verwahrstelle verwaltet werden. Diese muss einer aufsichtsrechtlichen Überwachung unterliegen und darf nicht mit der die Sicherheitsleistung bereitstellenden Partei verbunden sein.

Einzelheiten zu den durch Techniken eines effizienten Portfoliomanagements eingegangenen Risiken, den eingesetzten Kontrahenten, der Art und Höhe der zur Reduzierung dieser Risiken erhaltenen Sicherheiten und den Erträgen und Aufwendungen die, direkt oder indirekt, durch die Wertpapierleihe entstanden sind, werden in den periodischen Berichten der Gesellschaft angegeben.

Fonds, die für mindestens 30 % ihrer Anlagen Sicherheiten erhalten, werden regelmäßigen Stresstests gemäß der Politik der Gesellschaft für Liquiditätsstresstests unterzogen, um das mit den erhaltenen Sicherheiten verbundene Liquiditätsrisiko zu beurteilen.

Wiederanlage von Sicherheitsleistungen. Sicherheitsleistungen, die nicht in Form von Barmitteln erhalten werden, können nicht durch die Gesellschaft veräußert, verpfändet oder anderweitig angelegt werden.

Risikomanagement. Der Beitrag von DFI und der Einsatz anderer, oben beschriebenen Techniken eines effizienten Portfoliomanagements zum Risikoprofil eines Fonds wird in dessen Anlagepolitik offen gelegt. Ein Einsatz von Techniken eines effizienten Portfoliomanagements durch einen Fonds darf nicht zu einer Änderung in der Anlagepolitik des Fonds führen oder das Risikoprofil des Fonds wesentlich erhöhen. Obwohl ein Fonds durch seinen Einsatz von DFI und Techniken des effizienten Portfoliomanagements einer Hebelwirkung (Leverage) unterliegen kann, wird das daraus resultierende Gesamtrisiko des Fonds nicht dessen gesamtes Nettovermögen übersteigen, d. h. der Fonds darf nur bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts gehebelt sein, sofern im maßgeblichen Zusatz für einen Fonds nichts Abweichendes festgelegt ist.

Das Gesamtrisiko und die Fremdfinanzierung der einzelnen Fonds wird mittels des sog. „Commitment Approach“ berechnet. Bei diesem Ansatz werden die DFI-Positionen der einzelnen Fonds in die entsprechenden Positionen in den zugrunde liegenden Vermögenswerten umgerechnet, und es wird versucht sicherzustellen, dass das DFI-Risiko in Bezug auf etwaige zukünftige „Verpflichtungen“ (Commitments), denen der Fonds (ggf.) unterliegt, überwacht wird. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ lesen, um sich über die mit dem Einsatz von DFI verbundenen Risiken zu informieren. Die Verwaltungsgesellschaft wendet für jeden Fonds eine RMP-Erklärung an, die sie in die Lage versetzt, die verschiedenen mit DFI, dem Einsatz von Techniken eines effizienten Portfoliomanagements und der Sicherheitenmanagement verbundenen Risiken genau zu messen, zu überwachen und zu steuern. Der Anlageverwalter wird nur DFI einsetzen, die

vom jeweils gültigen Risikomanagementprozess abgedeckt sind. Eine Erklärung zu diesem Risikomanagementprozess wurde bei der Zentralbank eingereicht und von dieser genehmigt. Falls ein Fonds plant, zusätzliche Arten von DFI einzusetzen, müssen der Risikomanagementprozess und der maßgebliche Nachtrag entsprechend geändert werden. Die Verwaltungsgesellschaft wird den Anteilinhabern auf Aufforderung ergänzende Informationen in Bezug auf die für das Risikomanagement angewandten Methoden vorlegen, wozu u. a. auch die angewandten quantitativen Grenzwerte und alle jüngsten Entwicklungen in den Risiko- und Ertragsmerkmalen der Hauptanlagekategorien gehören.

Kreditaufnahme. Jeder Fonds kann bei einer Bank Kredite bis zu einer Obergrenze von 10 % seines Nettoinventarwerts aufnehmen. Dies aber nur vorübergehend. Liegen bei einem Fonds Kreditaufnahmen in Fremdwährungen vor, die den Wert der Gegeneinlage übersteigen, muss der Anlageverwalter sicherstellen, dass der darüber hinausgehende Betrag als Kreditaufnahme im Sinne von Vorschrift 103 OGAW-Vorschriften behandelt wird.

Pooling. Vorbehaltlich der allgemeinen Bestimmungen der Satzung und unter Einhaltung der Vorschriften der Zentralbank kann die Verwaltungsgesellschaft zum Zweck einer effizienten Portfolioverwaltung, sofern die Anlagepolitik des Fonds dies zulässt, entscheiden, dass die Vermögenswerte eines bestimmten Fonds gemeinsam mit den Vermögenswerten eines anderen Fonds verwaltet werden. Dies geschieht durch Einrichtung eines Pools mit Vermögenswerten („**Pool**“), der aus Barmitteln und Anlagen besteht, die von allen Fonds, die an dem Pool beteiligt sind („**Beteiligte Fonds**“), beigesteuert werden. Diese Technik wird „**Pooling**“ genannt.

Gelegenheiten zur Schaffung von Pooling-Arrangements ergeben sich, wenn sich Anlageziele und die Anlagepolitik der beteiligten Fonds in so weit ähneln, dass es möglich ist die Vermögenswerte, die von einem beteiligten Fonds beigesteuert werden, auf eine Art und Weise zu verwalten, die mit der Verwaltung aller anderen am Pool beteiligter Fonds identisch ist. Dabei ist es nicht unbedingt erforderlich, dass auch die Anlageziele und die Anlagepolitik der einzelnen am Pool beteiligten Fonds identisch sind. Es genügt, wenn der Anlageverwalter dazu fähig ist, den Pool als ein Portfolio von Vermögensanlagen zu verwalten, und gleichzeitig die Anlageziele, die Anlagepolitik und die Beschränkungen, die für jeden einzelnen beteiligten Fonds gelten, einhalten kann.

Ein Pool hat keine eigene Rechtspersönlichkeit und Anleger können nicht direkt in einen Pool investieren. Der Anlageverwalter darf die Vermögenswerte eines Fonds nicht ohne vorherige Einwilligung der Verwaltungsgesellschaft im Rahmen eines Pools verwalten. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Beteiligung des Fonds an einem Pool jederzeit durch Benachrichtigung des Anlageverwalters, des Administrators und der Verwahrstelle beenden. Weitere Details hierzu werden im maßgeblichen Nachtrag von Fonds, die „**Pooling**“ betreiben, beschrieben.

Operative Aspekte

Vermögenswerte können dem Pool durch den beteiligten Fonds jederzeit hinzugefügt und aus ihm entnommen werden. Es müssen Aufzeichnungen über die Vermögenswerte, die ein beteiligter Fonds dem Pool hinzufügt, und die prozentuale Allokation der einzelnen Vermögenswerte im Pool, die den einzelnen beteiligten Fonds zuzurechnen sind, und die für jeden Handelstag anteilig zugewiesen werden, geführt werden. Diese

prozentuale Allokation wird für alle Vermögenswerte, die im Pool gehalten werden, erfolgen. Wenn zusätzliche Barmittel oder Wertpapiere von einem beteiligten Fonds beigesteuert oder aus dem Pool abgezogen werden, wird der prozentuale Allokationsanteil der jeweiligen beteiligten Fonds dieser Veränderung angeglichen. Wird ein Beitrag in Barmitteln gestellt, erfolgt nach Maßgabe des Anlageverwalters ein Abzug zur Begleichung von Transaktions- und anderen Kosten sowie Finanzgebühren, die im Rahmen der Investition der entsprechenden Barmittel entstehen. Auf ähnliche Weise kann bei der Entnahme von Barmitteln ein Abzug zur Deckung der Transaktionskosten, die bei der Veräußerung der Wertpapiere entstehen, entstehen. Alle Transaktionskosten im Zusammenhang mit dem Eintritt bzw. dem Verlassen des Pools durch einen beteiligten Fonds werden von dem entsprechenden beteiligten Fonds getragen. Dividenden, Zinsen und andere Ausschüttungen von Einkünften, die im Zusammenhang mit den Vermögenswerten erzielt werden, werden den beteiligten Fonds gemäß ihrem Anteil an den Vermögenswerten zugewiesen. Zur Klarstellung wird festgehalten, dass Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die im Zusammenhang mit den Vermögenswerten im Pool stehen, unter den beteiligten Fonds gemäß den Aufzeichnungen über den beteiligten Fonds über den Administrator und die Verwahrstelle zugewiesen werden.

Anleger sollten beachten, dass das Pooling-Arrangement dazu führen kann, dass die Zusammensetzung der Vermögenswerte eines Fonds sich aufgrund von Zeichnungen und Einlösungen in einem anderen beteiligten Fonds, die dazu führen können, dass der Anlageverwalter Vermögenswerte aus dem Pool veräußert oder für diesen erwirbt, oder dass der Anlageverwalter den Betrag der zusätzlichen liquiden Mittel eines Fonds erhöht, ändern kann.

Verwahrung der Vermögenswerte

Die Verwahrstelle muss, auf Grundlage gemeinschaftlicher Aufzeichnungen des Buchhaltungssystems des Administrators, jederzeit gewährleisten, dass sie dazu in der Lage ist, die Vermögenswerte eines Fonds zu identifizieren. Dies auch dann, wenn die Aufzeichnungen einer Unterdepotbank die Vermögenswerte als vom Pool gehaltene Vermögenswerte identifizieren.

Auflösung

Die Verwaltungsgesellschaft kann die Beteiligung eines Fonds an einem Pool jederzeit durch Benachrichtigung des Anlageverwalters, des Administrators und der Verwahrstelle beenden. Nach solch einer Benachrichtigung werden die jeweiligen Anteile der beteiligten Fonds wieder den entsprechenden beteiligten Fonds zugewiesen.

Stimmrechtsvertretung & Asset-Stewardship

Stimmrechtsvertretungs- und Mitwirkungsaktivitäten in Bezug auf von den Fonds gehaltene Wertpapiere erfolgen gemäß den Bedingungen der Sustainability Proxy Voting and Engagement Policy („Richtlinie für eine nachhaltige Stimmrechtsvertretung und Engagement“), die unter [Sustainability Stewardship Service Proxy Voting and Engagement Policy](#) verfügbar ist (die „**Richtlinie für eine nachhaltige Stewardship**“).

Die Richtlinie für eine nachhaltige Stewardship konzentriert sich auf die Risiken und Chancen, die sich auf die

langfristige Wertschöpfung auswirken können. Dabei liegt der Schwerpunkt auf Nachhaltigkeitsprioritäten wie Klimawandel, Natur und Menschenrechte.

Die Gesellschaft hat die Zuständigkeit für die Ausübung von Stimmrechten und für Mitwirkungsaktivitäten gemäß der Richtlinie für eine nachhaltige Stewardship an den Anlageverwalter delegiert. Der Anlageverwalter kann nach seinem uneingeschränkten Ermessen jeweils eine unabhängige dritte Partei ernennen und ihr die mit bestimmten von den Fonds gehaltenen Wertpapieren verbundenen Stimmrechte übertragen, wenn dies aufgrund aufsichtsrechtlicher oder anderer Anforderungen erforderlich ist.

Regelmäßige Berichte über die Stimmrechtsvertretungs- und Mitwirkungsaktivitäten im Rahmen der Richtlinie für eine nachhaltige Stewardship sind unter [Sustainability Stewardship Service Proxy Voting and Engagement Policy](#) verfügbar.

Investor Voting Choice

Anleger, die an dem Programm Investor Voting Choice teilnehmen, können eine Richtlinie zur Stimmrechtsvertretung auswählen, die in Bezug auf ihren proportionalen Anteil an den von dem/den betreffenden Fonds, in den sie investieren, gehaltenen Aktien (für die Stimmrechte ausübbar sind) anwendbar ist. Eine im Rahmen des Programms Investor Voting Choice ausgewählte Richtlinie zur Stimmrechtsvertretung gilt anstelle der Richtlinie für eine nachhaltige Stewardship. Details hierzu sind der Offenlegung „Risiken im Zusammenhang mit angewiesener Stimmabgabe“ zu entnehmen.

ESG-Anlagen

Anlagen in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) bezeichnet die Beurteilung wesentlicher ESG-Themen während des Anlageprozesses. Sie ergänzt herkömmliches Research wie die Analyse von Abschlüssen, Branchentrends und Wachstumsstrategien von Unternehmen.

ESG-Anlagen können von Anlegern in vielerlei Weise zur Erzielung einer breiten Auswahl von Anlagezielen genutzt werden, u. a. Risikomanagement, Wertausrichtung und zur Steigerung einer nachhaltig langfristigen Wertentwicklung, und können in die Anlagepolitik eines Fonds gemäß Beschreibung im maßgeblichen Nachtrag auf einem oder mehreren, nachstehend näher beschriebenen Wegen einbezogen werden.

Um die verschiedenen Anlageziele dieser Anleger zu unterstützen, kann der Anlageverwalter ESG-Kriterien als Kernbereich oder zusätzlich zu der im maßgeblichen Nachtrag beschriebenen Anlagepolitik des Fonds anwenden. Das heißt, dass einige Fonds auf ESG-spezifische Ergebnisse abzielen, während andere Fonds, die nicht in erster Linie ESG-Ergebnisse zum Ziel haben, ESG-Tools zusätzlich zu ihrem Hauptziel zur Verbesserung des Risikomanagements und Ermöglichung verantwortlicher Anlagen einbeziehen. Jeder Fonds wurde gemäß SFDR klassifiziert, und dies wurde in den maßgeblichen Nachträgen angegeben.

Zusätzliche Informationen in Bezug den ESG-Anlageansatz von State Street Investment Management sind auf www.ssga.com/esg zu finden.

Die Fonds verfolgen keine Reduzierung negativer externer Effekte, die durch zugrunde liegende Anlagen verursacht werden, und berücksichtigen deshalb keine wesentlichen nachteiligen Auswirkungen ihrer Anlageentscheidungen, sofern nicht anderweitig im maßgeblichen Nachtrag angegeben.

Im Sinne von Artikel 4 der SFDR berücksichtigt die Verwaltungsgesellschaft nicht die nachteiligen Auswirkungen von Anlageentscheidungen in Bezug auf Nachhaltigkeitsfaktoren auf ihrer Unternehmensebene.

ESG-Screening

Bei bestimmten Fonds wird der maßgebliche Index negative und/oder normbasiertes Screening einbeziehen, beispielsweise durch den Ausschluss von mit bestimmten Sektoren, Unternehmen oder Praktiken verbundenen Wertpapieren auf der Grundlage spezieller ESG-Kriterien. Ein Beispiel für normbasiertes Screening ist der Ausschluss von Wertpapieren, die von Unternehmen emittiert wurden, die nach Research als gegen internationale Normen in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsrichtlinien und Antikorruption verstoßend befunden wurden.

Ein Beispiel für einen negativen Filter ist der Ausschluss von Wertpapieren, die von Unternehmen emittiert wurden, die nach Research als im Bereich von kontroversen Waffen gemäß Festlegung im Übereinkommen über Streumunition tätig befunden wurden, und/oder die Ausschlüsse von Unternehmen auf der Grundlage anderer ESG-Kriterien wie etwa die ESG-Ratingschwellen.

Bei Fonds, die einen ESG-Screening-Ansatz einbeziehen, wird ein negativer und/oder normbasierter ESG-Filter beim Index selbst eingesetzt (gemäß Beschreibung im maßgeblichen Nachtrag). Das heißt, dass der Indexanbieter vor dem Aufbau des Index und fortlaufend bestimmte Wertpapiere aus dem Anlageuniversum basierend auf einer Beurteilung ihrer Einhaltung bestimmter ESG-Kriterien, wie im maßgeblichen Nachtrag erläutert, unter Einsatz der ESG-Screening-Methode für Ausschlüsse ausschließt. Die ESG-Screening-Methode für Ausschlüsse des Indexanbieters steht auf der im maßgeblichen Nachtrag angegebenen Website zur Verfügung. Für weitere Informationen sollten Anleger den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ unter „**Anlagestrategien**“ lesen.

„Best-in-Class“-ESG-Anlagen

„Best-in-Class“-ESG-Anlagen bezieht sich auf die Zusammensetzung von Portfolios, die systematisch Unternehmen mit einer besseren ESG-Performance im Vergleich zu Anlageuniversen und/oder Branchenmitbewerbern anhand einer Beurteilung nach objektiven Kriterien bevorzugen. Siehe den jeweiligen maßgeblichen Nachtrag für Einzelheiten dazu, wo „Best-in-Class“-ESG-Anlagen eingebettet sind.

Taxonomie-Verordnung

Die Taxonomie-Verordnung legt Kriterien fest, anhand derer bestimmt wird, ob eine wirtschaftliche Tätigkeit im Zusammenhang mit bestimmten Umweltzielen als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.

Die Taxonomie-Verordnung verpflichtet die Verwaltungsgesellschaft zur Offenlegung (i) der Art und Weise sowie des Umfangs, in dem sie die Taxonomie-Verordnung zur Bestimmung der Nachhaltigkeit der zugrunde liegenden Anlagen der Fonds verwendet hat, und

(ii) des Beitrags der zugrunde liegenden Anlagen zu welchen Umweltzielen, wie in der Taxonomie-Verordnung dargelegt.

Sofern im entsprechenden Nachtrag nicht anders angegeben, werden bei den Anlagen in den Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltiges Wirtschaften nicht berücksichtigt.

Einbeziehung von ESG

Die Einbeziehung von ESG bezeichnet die Einbeziehung qualitativer und quantitativer ESG-Informationen in den Anlageprozess, einschließlich Nachhaltigkeitsrisiken, und soll Anlageentscheidungen optimieren. Die Einbeziehung von ESG zielt darauf ab, die finanzielle Performance zu verbessern und/oder die finanziellen Risiken zu mindern. Dabei werden ESG-Faktoren explizit und systematisch in Anlageanalyse und -entscheidungen einbezogen, um die Risiken zu senken und Erträge zu generieren. Die Einbeziehung von ESG ist ein breit angelegtes Instrument, bei dem wesentliche ESG-Komponenten als Risiko- und/oder Renditetreiber betrachtet werden und nicht als Mittel, um bestimmte ökologische, soziale und/oder die Unternehmensführung betreffende Ziele zu erreichen. Die Anwendung der Einbeziehung von ESG auf einen bestimmten Fonds sollte passgenau auf die jeweilige Anlageklasse, Anlagestrategie und das angestrebte Ergebnis zugeschnitten werden. Bei der Erwägung der geeigneten Konzeption wird der Anlageverwalter beurteilen, ob und wie finanziell wesentliche ESG-Themen in seine Entscheidungsprozesse integriert werden, er wird angemessene ESG-Signale und -Faktoren zur Risikominderung berücksichtigen und Chancen für die langfristige Performance ermitteln.

Kauf- und Verkaufsinformationen

Primärmärkte. Ein Fonds wird ETF-Anteile an autorisierte Teilnehmer in hohen Volumen gemäß den Bestimmungen dieses Prospekts ausgeben (oder zurücknehmen). ETF-Anteile können gegen Barmittel, Wertpapiere oder eine Kombination aus Barmitteln und Wertpapieren ausgegeben und zurückgenommen werden.

Ein Fonds wird Nicht-ETF-Anteile gemäß den Bestimmungen dieses Prospekts an Anleger ausgeben (bzw. einlösen). Nicht-ETF-Anteile können gegen Barmittel, Wertpapiere oder eine Kombination aus Barmitteln und Wertpapieren ausgegeben und zurückgenommen werden.

Ungeachtet anderslautender Informationen in diesem Abschnitt und im Absatz mit der Überschrift „Zeichnungen von ETF-Anteilen“ unter der Überschrift „Primärmärkte“ im Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen“ des Prospekts können ETF-Anteile in einem Fonds im Zusammenhang mit einer geplanten Zusammenlegung oder Verschmelzung eines Organismus oder mehrerer Organismen für gemeinsame Anlagen mit einem Fonds („**die verschmelzenden Fonds**“) direkt an Anleger der verschmelzenden Fonds ausgegeben werden, die keine autorisierten Teilnehmer sind.

Nach Erhalt dieser ETF-Anteile können die autorisierten Teilnehmer der verschmelzenden Fonds, die keine autorisierten teilnehmenden Händler sind, weder diese ETF-Anteile direkt an die Gesellschaft zurückgeben, außer unter außerordentlichen, vom Verwaltungsrat festgelegten Umständen, wie im Unterabschnitt „Sekundärmarkt – Sekundärmarktkäufe und Verkäufe von ETF-Anteilen“ im Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen“ des Prospekts angegeben, noch können die Anleger der verschmelzenden

Fonds neue ETF-Anteile direkt zeichnen.

Sekundärmärkte. ETF-Anteile können in kleineren Volumen an der/den maßgeblichen Wertpapierbörse(n) über Makler zu Marktpreisen gekauft und verkauft werden. Da ETF-Anteile an den Wertpapierbörsen zu Marktpreisen und nicht zum Nettoinventarwert je Anteil gehandelt werden, können ETF-Anteile zu einem höheren Preis als dem Nettoinventarwert je Anteil (mit einem Aufschlag) oder zu einem niedrigeren Preis als dem Nettoinventarwert je Anteil (mit einem Abschlag) gehandelt werden. Anleger sollten auch die Risikowarnung unter der Überschrift „Risiko - Kosten des Kaufs oder Verkaufs von ETF-Anteilen“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ lesen. Hier finden sie weitere Informationen zu den Risiken im Zusammenhang mit dem Kauf und Verkauf von Anteilen im Sekundärmarkt. Unter, nach Maßgabe des Verwaltungsrats, außergewöhnlichen Umständen können Anleger bei der Gesellschaft beantragen, dass sie als Eigentümer von ETF-Anteilen, die im Sekundärmarkt erworben wurden, registriert werden, so dass sie auf die Rücknahmemöglichkeiten des Primärmarkts zugreifen können.

Anleger sollten für nähere Einzelheiten den Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen“ lesen.

Funktion des Zeichnungs- und Rücknahmesammelkontos

Die Gesellschaft hat auf Umbrella-Ebene Sammelkonten im Namen der Gesellschaft (die „**Umbrella-Barsammelkonten**“) eingerichtet. Solche Konten wurden nicht auf Fondsebene eingerichtet. Alle Zeichnungen für und Rücknahmen und Ausschüttungen von Fonds werden in die Umbrella-Barsammelkonten eingezahlt. Barmittel in den Umbrella-Barsammelkonten, einschließlich frühzeitig erhaltener Zeichnungsgelder, die für einen Fonds erhalten wurden, fallen nicht unter den Schutz des Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) Investor Money Regulations 2015 (in seiner jeweils gültigen Form) für Anbieter von Fondsdienstleistungen.

Bis zur Ausgabe der Anteile und bis zur Zahlung der Rücknahmeerlöse oder Ausschüttungen ist der jeweilige Anleger in Hinblick auf die von ihm bezahlten bzw. die an ihn zu zahlenden Beträge ein nicht sichergestellter Gläubiger des jeweiligen Fonds.

Alle Zeichnungen (einschließlich Zeichnungen, die vor Ausgabe der Anteile erhalten werden), die einem Fonds zuzurechnen sind, und alle Rücknahmen, Dividenden oder Barausschüttungen, die von einem Fonds zu zahlen sind, werden über die Umbrella-Barsammelkonten geleitet und gesteuert. Zeichnungsbeträge, die in die Umbrella-Barsammelkonten eingezahlt werden, werden für den jeweiligen Fonds in ein Konto im Namen der Verwahrstelle einbezahlt. Rücknahmen und Ausschüttungen, einschließlich gesperrter Rücknahmen oder Ausschüttungen, werden bis zum Fälligkeitstermin (bzw. dem späteren Termin, an dem gesperrte Zahlungen gezahlt werden dürfen) in den Umbrella-Barsammelkonten gehalten und dann an den jeweiligen, rückgebenden Anteilinhaber ausbezahlt.

Für die Verwahrung und die Beaufsichtigung der Gelder in den Umbrella-Barsammelkonten und für die Sicherstellung, dass sich die jeweiligen Beträge in den Umbrella-Barsammelkonten den entsprechenden Fonds zurechnen lassen, ist die Verwahrstelle verantwortlich.

Die Gesellschaft und die Verwahrstelle haben ein Verfahren

für die Umbrella-Barsammelkonten vereinbart, das die beteiligten Fonds, die Verfahren und Protokolle, die bei dem Transfer von Geldern aus den Umbrella-Barsammelkonten zu befolgen sind, die täglichen Abgleichprozesse und die Verfahren, die befolgt werden müssen, falls in Hinblick auf einen Fonds aufgrund der verspäteten Zahlung von Zeichnungen und/oder aufgrund von Zeitunterschieden bei Transfers von Geldern, die einem anderen Fonds zuzurechnen sind, an einen Fonds Defizite bestehen, identifiziert.

Gehen in den Umbrella-Barsammelkonten Zeichnungsgelder ohne hinreichende Dokumentation zur Identifikation des Anlegers oder des jeweiligen Fonds ein, werden diese Gelder innerhalb von fünf Geschäftstagen an den jeweiligen Anleger zurückgeführt. Das Versäumnis, eine erforderliche und genaue Dokumentation bereitzustellen, geht auf das Risiko des Anlegers.

Steuerinformationen

Die Gesellschaft ist für steuerliche Zwecke in Irland ansässig und unterliegt keinen irischen Steuern auf Erträge oder Veräußerungsgewinne. Auf die Ausgabe, Rücknahme oder Übertragung von Anteilen der Gesellschaft ist keine irische Stempelsteuer zahlbar. Ein Fonds kann Ausschüttungen vornehmen, die als gewöhnliche Erträge oder Veräußerungsgewinne besteuert werden können. Die Ausschüttungspolitik der einzelnen Fonds wird im maßgeblichen Nachtrag beschrieben. Die steuerliche Behandlung ist abhängig von der individuellen Situation des Anteilinhabers. Dementsprechend wird Anteilinhabern und potenziellen Anlegern empfohlen, sich im Hinblick auf eine mögliche Besteuerung oder sonstige Folgen des Kaufs, Haltens, Verkaufs, Tauschs oder einer anderweitigen Veräußerung der Anteile nach den Gesetzen des Landes ihrer Gründung, Niederlassung, Staatsbürgerschaft, ihres Wohnsitzes, gewöhnlichen Wohnsitzes oder Geschäftssitzes von ihren fachkundigen Beratern beraten zu lassen.

Sonstige Informationen

Profil eines Anlegers. Die Gesellschaft wurde zum Zwecke der Anlage in Wertpapieren gemäß den OGAW-Vorschriften gegründet. Die Anlageziele und die Anlagepolitik der einzelnen Fonds werden im maßgeblichen Nachtrag beschrieben. Sofern im maßgeblichen Nachtrag nichts anderes angegeben ist, sind typische Anleger voraussichtlich private und institutionelle Anleger.

Bericht und Abschluss. Die Rechnungsperiode der Gesellschaft endet in jedem Jahr am 31. März. Die Gesellschaft wird innerhalb von vier Monaten ab Ende des Geschäftszeitraums, auf den sie sich beziehen, einen Jahresbericht und einen geprüften Jahresabschluss erstellen, d. h. normalerweise im Juli jedes Jahres. Die ungeprüften Halbjahresberichte der Gesellschaft werden bis zum 30. September jedes Jahres erstellt. Die ungeprüften Halbjahresberichte werden innerhalb von zwei Monaten nach Ende des Halbjahreszeitraums, auf den sie sich beziehen, veröffentlicht, d.h. normalerweise im November jeden Jahres. Der Jahresbericht und der Halbjahresbericht werden auf der Website veröffentlicht und können den Anteilinhabern per E-Mail oder über ein anderes elektronisches Kommunikationsmittel übersandt werden. Anteilinhaber und potenzielle Anleger können jedoch auch

gedruckte Kopien anfordern.

Satzung. Anteilinhaber haben Anspruch auf die Leistungen, die ihnen laut Bestimmungen der Gesellschaftssatzung zustehen, sie sind an die Satzung gebunden und es wird vorausgesetzt, dass sie Kenntnis der Satzung haben. Im Abschnitt „**Wo finden Sie nähere Informationen über die Fonds?**“ erfahren Sie, wo Sie Kopien der Satzung erhalten können.

Grundkapital. Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft beträgt 500.000.000.002 (fünfhundert Milliarden und zwei) nennwertlose Anteile und ist in zwei nennwertlose Zeichneranteile und 500.000.000.000 (fünfhundert Milliarden) nennwertlose Anteile unterteilt. Der Verwaltungsrat ist befugt, alle Anteile der Gesellschaft zu den Bedingungen auszugeben, die er für angemessen erachtet. Die Zeichneranteile berechtigen die Inhaber zur Teilnahme und Abstimmung auf Hauptversammlungen der Gesellschaft, berechtigen die Inhaber jedoch nicht, am Gewinn oder am Vermögen der Gesellschaft zu partizipieren, mit Ausnahme einer Kapitalrückzahlung im Falle einer Abwicklung. Die Anteile (mit Ausnahme von Zeichneranteilen) berechtigen die Inhaber zur Teilnahme und Stimmabgabe auf Hauptversammlungen der Gesellschaft sowie zur gleichen Beteiligung an den Gewinnen und Vermögenswerten der Gesellschaft (vorbehaltlich ggf. unterschiedlicher Gebühren, Kosten und Auslagen verschiedener Anteilsklassen). Die Gesellschaft kann von Zeit zu Zeit durch einfachen Mehrheitsbeschluss ihr Kapital erhöhen, die Gesamtheit oder einen Teil ihrer Anteile in eine kleinere Anzahl von Anteilen konsolidieren oder die Gesamtheit oder einen Teil ihrer Anteile unterteilen, so dass eine höhere Anzahl von Anteilen entsteht, oder Anteile annullieren, die weder gezeichnet wurden noch Gegenstand einer Zeichnungsvereinbarung mit irgendeiner Person sind. Die Gesellschaft kann von Zeit zu Zeit ihr Grundkapital in jeder gesetzlich zulässigen Weise durch Sonderbeschluss reduzieren. Auf den Hauptversammlungen der Anteilinhaber hat jeder Anteilinhaber bei Abstimmungen per Handzeichen eine Stimme, und bei Abstimmungen mit Stimmzetteln hat jeder Anteilinhaber eine Stimme für jeden ganzen von diesem Anteilinhaber gehaltenen Anteil.

Verbreitungs- und Verkaufsbeschränkungen. Die Verbreitung dieses Prospekts und das Anbieten oder der Verkauf von Anteilen kann in bestimmten Rechtsordnungen eingeschränkt sein. Dieser Prospekt stellt kein Angebot bzw. keine Aufforderung von einer oder an eine Person in Rechtsordnungen dar, in denen ein solches Angebot oder eine solche Aufforderung nicht rechtmäßig ist oder in der diese das Angebot unterbreitende oder die Aufforderung abgebende Person dazu nicht zugelassen ist oder in denen es unrechtmäßig ist, einer Person ein solches Angebot zu unterbreiten oder eine solche Aufforderung abzugeben. Personen, die im Besitz dieses Prospekts sind, und Personen, die auf der Grundlage dieses Prospekts Anteile zeichnen möchten, sind verantwortlich dafür, sich über alle geltenden Gesetze und Vorschriften der jeweiligen Rechtsordnung zu informieren und diese einzuhalten.

Anteile werden nur auf der Grundlage der in diesem Prospekt enthaltenen Informationen angeboten. Weitere Informationen oder Erklärungen, die von einem Händler, einem Makler oder einer sonstigen Person abgegeben oder

gemacht werden, sollten ignoriert werden und sind folglich nicht vertrauenswürdig. Niemand wurde ermächtigt, im Zusammenhang mit dem Angebot von Anteilen andere Informationen zu verbreiten oder andere Erklärungen abzugeben, als die in diesem Prospekt der Gesellschaft enthaltenen. Falls derartige Informationen gegeben oder Behauptungen aufgestellt werden, darf nicht davon ausgegangen werden, dass sie vom Verwaltungsrat oder der Verwaltungsgesellschaft genehmigt worden sind. Aussagen in diesem Prospekt entsprechen der zum Datum dieses Prospekts geltenden Rechtslage und Rechtspraxis in Irland und können Änderungen unterliegen. Aus der Aushändigung dieses Prospekts oder aus der Ausgabe von Anteilen darf unter keinen Umständen gefolgert werden, dass die Lage der Gesellschaft seit dem Datum dieses Prospekts unverändert geblieben ist.

Dieser Prospekt kann auch in andere Sprachen übersetzt werden. Diese Übersetzungen müssen dieselben Informationen enthalten und dieselbe Bedeutung haben wie der englischsprachige Prospekt. Sofern zwischen dem englischsprachigen Prospekt und dem Prospekt in einer anderen Sprache Unstimmigkeiten auftreten, ist der englischsprachige Prospekt maßgeblich. Ausnahmsweise ist eine andere Sprache dann und insoweit maßgeblich, wie das Gesetz einer Rechtsordnung, in dem die Anteile verkauft werden, dies für Klagen, die sich auf Angaben in einem Prospekt in einer anderen Sprache als Englisch beziehen, verlangt. Sämtliche Streitigkeiten in Bezug auf die Inhalte dieses Prospekts unterliegen dem Recht Irlands.

Fonds. Gemäß der Satzung muss der Verwaltungsrat wie folgt einen separaten Fonds mit separater Buchführung einrichten:

- a) Die Gesellschaft führt für jeden Fonds separate Bücher und Aufzeichnungen. Die Erlöse aus der Ausgabe von Anteilen für einen Fonds werden diesem Fonds zugeordnet, und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sowie die Erträge und Aufwendungen, die diesem Fonds zuzurechnen sind, werden diesem Fonds zugeordnet.
- b) Ein Vermögenswert, der sich aus einem anderen Vermögenswert in einem Fonds ableitet, wird demselben Fonds zugeordnet wie der Vermögenswert, von dem er abgeleitet wurde, und ein Wertgewinn oder Wertverlust eines solchen Vermögenswerts wird dem betreffenden Fonds zugeordnet.
- c) Falls ein Vermögenswert nach Einschätzung des Verwaltungsrats nicht eindeutig einem oder mehreren bestimmten Fonds zugeordnet werden kann, so bestimmt der Verwaltungsrat nach seinem Ermessen in angemessener und gerechter Weise und mit Zustimmung der Verwahrstelle die Basis, auf der solche Vermögenswerte zwischen den Fonds zugeordnet werden, und der Verwaltungsrat kann diese Basis jederzeit und von Zeit zu Zeit ändern.
- d) Verbindlichkeiten werden dem bzw. den Fonds zugeordnet, auf den/die sie sich nach Meinung des

Verwaltungsrats beziehen. Falls eine solche Verbindlichkeit nicht eindeutig einem bestimmten Fonds zugeordnet werden kann, so bestimmt der Verwaltungsrat nach seinem Ermessen in angemessener und gerechter Weise und mit Zustimmung der Verwahrstelle die Basis, auf der solche Verbindlichkeiten zwischen den Fonds zugeordnet werden, und der Verwaltungsrat kann diese Basis jederzeit und von Zeit zu Zeit ändern.

- e) Falls die einem Fonds zuzuordnenden Vermögenswerte zur Erfüllung einer Verbindlichkeit herangezogen werden, die diesem Fonds nicht zuzuordnen ist, und soweit diese Vermögenswerte oder ein Ausgleich hierfür nicht auf andere Weise dem betroffenen Fonds wieder zugeführt werden können, hat der Verwaltungsrat mit Zustimmung der Verwahrstelle den Wert der verlorenen Vermögenswerte des betroffenen Fonds zu bestätigen bzw. bestätigen zu lassen und aus den Vermögenswerten des bzw. der Fonds, dem bzw. denen die Verbindlichkeit zuzuordnen war, mit Vorrang vor allen anderen Ansprüchen gegen diesen bzw. diese Fonds, die Vermögenswerte oder Beträge zu übertragen bzw. zahlen, die ausreichend sind, um dem betroffenen Fonds den Wert der verlorenen Vermögenswerte oder Beträge wieder zuzuführen.
- f) Wo Vermögenswerte der Gesellschaft, die den Zeichneranteilen zuzuordnen sind (sofern vorhanden), einen Nettogewinn erzielen, kann der Verwaltungsrat Vermögenswerte, die diesen Nettogewinn darstellen, einem oder mehreren von ihnen für geeignet erachteten Fonds in angemessener und gerechter Weise zuteilen.
- g) Vorbehaltlich anderweitiger Regelungen in der Satzung, sind die auf Rechnung jedes Teilfonds gehaltenen Vermögenswerte ausschließlich in Bezug auf die Anteile zu verwenden, zu denen dieser Teilfonds gehört, und gehören ausschließlich dem betreffenden Teilfonds und dürfen nicht zur direkten oder indirekten Erfüllung der Verbindlichkeiten von oder Forderungen gegen einen anderen Teilfonds verwendet werden und stehen für einen solchen Zweck nicht zur Verfügung.

Jeder Anteil (mit Ausnahme von Zeichneranteilen) berechtigt den Anteilinhaber zu einer entsprechenden anteilmäßigen Beteiligung an den Dividenden und dem Nettovermögen des jeweiligen Fonds, in Bezug auf den diese Anteile ausgegeben wurden. Ausgenommen hiervon sind Dividenden, die bereits beschlossen wurden, bevor er Anteilinhaber wurde. Die Zeichneranteile berechtigen die Anteilinhaber, von denen sie gehalten werden, zur Teilnahme und Stimmabgabe auf Hauptversammlungen der Gesellschaft, nicht jedoch zur Partizipation an Dividenden oder dem Nettovermögen eines Fonds.

Informationsanfragen. Die Gesellschaft oder ihr ordnungsgemäß bevollmächtigter Vertreter können Anleger jederzeit auffordern, ihnen Informationen vorzulegen über: (a) die Eigenschaft, in der sie eine Beteiligung an Anteilen halten; (b) die Identität anderer Personen, die an diesen

Anteilen aktuell beteiligt sind oder zu einem früheren Zeitpunkt beteiligt waren; (c) die Art solcher Beteiligungen; und (d) sonstige Angelegenheiten, wenn die Offenlegung dieser Angelegenheiten erforderlich ist, damit die Gesellschaft anwendbare Gesetze oder die Bestimmungen ihrer Gründungsdokumente einhalten kann.

Abwicklung. Im Allgemeinen wird nach irischem Recht, wenn ein Unternehmen liquidiert wird, ein Liquidator ernannt, der ausstehende Forderungen begleicht und die verbleibenden Vermögenswerte der Gesellschaft verteilt. Der Liquidator verwendet die Vermögenswerte der Gesellschaft, um die Forderungen der Gläubiger zu befriedigen. Danach verteilt der Liquidator die verbleibenden Vermögenswerte unter den Anteilinhabern. Die Satzung enthält Bestimmungen, wonach die Vermögenswerte nach Begleichung der Verbindlichkeiten eines Fonds zuerst an die Anteilinhaber des jeweiligen Fonds ausgeschüttet werden und danach der für die Zeichneranteile gezahlte Nennwert an die Inhaber dieser Zeichneranteile. Der Liquidator kann, wenn er durch Sonderbeschluss dazu ermächtigt wird, Vermögenswerte der Gesellschaft in Sachwerten ausschütten, unter dem Vorbehalt, dass unter solchen Umständen die Anteilinhaber verlangen können, dass die an sie auszuschüttenden Vermögenswerte verkauft werden und der Nettobarerlös an sie ausgezahlt wird.

Anlagebeschränkungen

Die Vermögenswerte der einzelnen Fonds werden gemäß den Anlagebeschränkungen in den OGAW-Vorschriften, die weiter unten zusammengefasst werden, sowie gemäß den etwaigen zusätzlichen von der Verwaltungsgesellschaft festgelegten Anlagebeschränkungen angelegt. Die Einzelheiten zu den zusätzlichen Anlagebeschränkungen sind nachstehend und/oder im maßgeblichen Nachtrag aufgeführt.

1. Zugelassene Anlagen

Die Anlagen eines Fonds sind beschränkt auf:

- 1.1. in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die entweder zur amtlichen Notierung an einer Börse in einem Mitgliedstaat oder Nicht-Mitgliedstaat zugelassen sind oder die auf einem Markt gehandelt werden, der geregelt ist, regelmäßig stattfindet, anerkannt und für die Öffentlichkeit in einem Mitgliedstaat oder Nicht-Mitgliedstaat zugänglich ist;
- 1.2. kürzlich emittierte Wertpapiere, die innerhalb eines Jahres zur amtlichen Notierung an einer Wertpapierbörse oder einem sonstigen Markt (wie vorstehend erläutert) zugelassen werden;
- 1.3. Geldmarktinstrumente, die nicht an einem regulierten Markt gehandelte Geldmarktinstrumente sind;
- 1.4. Anteile von OGAW;

- 1.5. Anteile an alternativen Investmentfonds;
- 1.6. Einlagen bei Kreditinstituten; und
- 1.7. derivative Finanzinstrumente.

2. Anlagebeschränkungen

- 2.1. Ein Fonds darf höchstens 10 % seines Nettovermögens in anderen als den vorstehend in Abschnitt 1 genannten Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten anlegen.
- 2.2. (1) Vorbehaltlich Absatz (2) darf eine verantwortliche Person nicht mehr als 10 % des Vermögens eines Fonds in Wertpapiere des Typs investieren, auf den die Vorschrift 68(1)(d) der OGAW-Vorschriften Anwendung findet.

(2) Absatz (1) gilt nicht für die Anlage einer verantwortlichen Person in US-Wertpapiere, die als „Rule 144 A-Wertpapiere“ bezeichnet werden, sofern:
 - die jeweiligen Wertpapiere mit der Verpflichtung emittiert werden, dass sie innerhalb eines Jahres nach Emission bei der US-Wertpapier- und Börsenaufsichtsbehörde registriert werden; und dass
 - die Wertpapiere keine illiquiden Wertpapiere sind, d. h. sie können vom Fonds innerhalb von sieben Tagen zu dem Preis bzw. dem annähernden Preis, zu dem sie vom Fonds bewertet werden, realisiert werden.
- 2.3. Ein Fonds darf höchstens 10 % seines Nettovermögens in Wertpapieren oder Geldmarktinstrumenten ein und desselben Emittenten anlegen, sofern der Gesamtwert der Wertpapiere und Geldmarktinstrumente der Emittenten, bei denen jeweils mehr als 5 % angelegt werden, maximal bei 40 % liegt.
- 2.4. Vorbehaltlich der vorherigen Genehmigung der Zentralbank erhöht sich die Grenze von 10 % (siehe Ziffer 2.3) auf 25 % bei Schuldverschreibungen, die von einem Kreditinstitut mit eingetragenem Sitz in einem Mitgliedstaat begeben werden, das aufgrund gesetzlicher Vorschriften zum Schutz der Inhaber von Schuldverschreibungen einer besonderen öffentlichen Aufsicht unterliegt. Sofern ein Fonds mehr als 5 % seines Nettovermögens in solchen Schuldverschreibungen von ein und demselben Emittenten anlegt, darf der Gesamtwert dieser Anlagen 80 % des

Nettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigen.

- 2.5. Die Grenze von 10 % (siehe Ziffer 2,3) erhöht sich auf 35 %, wenn die Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente von einem Mitgliedstaat oder seinen Gebietskörperschaften oder einem Nicht-Mitgliedstaat oder einer internationalen Körperschaft öffentlichen Rechts, der ein oder mehrere Mitgliedstaaten als Mitglieder angehören, begeben oder garantiert sind.
- 2.6. Die in den Ziffern 2.4 und 2.5 genannten Wertpapiere und Geldmarktinstrumente werden bei der Anwendung der in Ziffer 2.3 vorgesehenen Grenze von 40 % nicht berücksichtigt.
- 2.7. Ein Fonds darf maximal 20 % seines Nettovermögens als Einlagen bei ein und derselben Organisation investieren.
- 2.8. Das Risiko, dem ein Teilfonds durch einen Kontrahenten eines Derivatgeschäfts im Freiverkehr (**OTC-Derivatgeschäft**) ausgesetzt ist, darf 5 % des Nettovermögens nicht übersteigen.

Bei einem im Europäischen Wirtschaftsraum zugelassenen Kreditinstitut, einem in einem Mitgliedstaat (mit Ausnahme eines EWR-Mitgliedstaates) des Baseler Kapitalkonvergenzabkommens vom Juli 1988 lizenzierten Kapitalinstitut oder einem Kreditinstitut, das in einem Drittland zugelassen ist, das gemäß Artikel 107(4) der Kapitaladäquanzverordnung (EU) Nr. 575/2013 als gleichwertig anzusehen ist, oder einem anderen von der Zentralbank zugelassenen Unternehmen wird diese Grenze auf 10 % erhöht.

- 2.9. Unbeschadet der Ziffern 2.3, 2.7 und 2.8 darf eine Kombination zweier oder mehrerer der folgenden Anlagen oder Risiken, die von ein und demselben Emittenten ausgegeben werden bzw. die im Rahmen einer Transaktion mit ein und demselben Kontrahenten eingegangen werden, 20 % des Nettovermögens nicht überschreiten:
 - (i) Anlagen in Wertpapieren oder Geldmarktinstrumenten;
 - (ii) Einlagen und/oder
 - (iii) Kontrahentenrisikopositionen im Zusammenhang mit OTC-Derivategeschäften.
- 2.10. Die in den Ziffern 2.3, 2.4, 2.5, 2.7, 2.8 und 2.9 genannten Grenzen dürfen nicht kombiniert werden; daher darf das Engagement in einem einzelnen

Emittenten 35 % des Nettovermögens des betreffenden Fonds nicht übersteigen.

- 2.11. Eine Unternehmensgruppe wird zum Zweck der Ziffern 2.3, 2.4, 2.5, 2.7, 2.8 und 2.9 als Einzelemittent angesehen. Auf die Anlage in Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten innerhalb desselben Konzerns kann jedoch ein Grenzwert von 20 % des Nettovermögens eines Fonds angelegt werden.
- 2.12. Jeder Fonds kann bis zu 100 % des Nettovermögens in unterschiedlichen Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten anlegen, die von einem Mitgliedsstaat oder seinen Gebietskörperschaften oder einem Nicht-Mitgliedsstaat oder einer internationalen Körperschaft öffentlichen Rechts, der ein oder mehrere Mitgliedstaaten als Mitglieder angehören, begeben oder garantiert sind. Die einzelnen Emittenten müssen im Prospekt angegeben sein und können der folgenden Liste entnommen werden: OECD-Staaten (sofern die Emissionen mit Investment Grade eingestuft sind), die Regierungen von Brasilien oder Indien (sofern die jeweiligen Emissionen mit Investment Grade eingestuft sind), die Regierung der Volksrepublik China (sofern die jeweiligen Emissionen mit Investment Grade eingestuft sind), das Königreich Saudi-Arabien (sofern die Emissionen mit Investment Grade eingestuft sind), Europäische Investitionsbank, Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung, International Finance Corporation, Internationaler Währungsfonds, Euratom, Asiatische Entwicklungsbank, Europäische Zentralbank, Europarat, Eurofima, Afrikanische Entwicklungsbank, Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung (die Weltbank), Interamerikanische Entwicklungsbank, Europäische Union, Federal National Mortgage Association (Fannie Mae), Federal Home Loan Mortgage Corporation (Freddie Mac), Government National Mortgage Association (Ginnie Mae), Student Loan Marketing Association (Sallie Mae), Federal Home Loan Bank, Federal Farm Credit Bank, Tennessee Valley Authority, die Regierung von Singapur, Straight-A Funding LLC.

Ein Fonds muss Wertpapiere aus mindestens 6 verschiedenen Emissionen besitzen, wobei die Papiere aus einer einzelnen Emission 30 % des Nettoinventarwerts nicht übersteigen dürfen.

3. Anlage in Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“)

- 3.1. Ein Fonds darf insgesamt höchstens 10 % seines Nettovermögens in einem anderen OGA anlegen. Solche CIS dürfen ihrerseits insgesamt höchstens 10 % ihres Nettovermögens in anderen offenen OGA anlegen. Die Anlagen in alternativen Investmentfonds dürfen insgesamt maximal 30 % des Nettovermögens ausmachen.
- 3.2. Erwirbt ein Fonds Anteile anderer OGA, die unmittelbar oder mittelbar durch eine OGAW-Verwaltungsgesellschaft oder durch eine sonstige Gesellschaft verwaltet werden, mit der diese Verwaltungsgesellschaft durch gemeinsame Verwaltung oder Kontrolle oder durch eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist, darf diese Verwaltungsgesellschaft oder sonstige Gesellschaft aufgrund der Anlagen der Gesellschaft in den Anteilen dieser anderen OGA keine Zeichnungs-, Umtausch- oder Rücknahmegebühren erheben.
- 3.3. Erhält der Anlageverwalter für eine Anlage in Anteilen eines anderen OGA eine Provision (einschließlich rückvergüteter Provisionen), muss diese Provision in das Vermögen des betreffenden Fonds einfließen.

4. Indexnachbildende OGAW

- 4.1. Zielt die Anlagestrategie eines Fonds darauf ab, einen Index nachzubilden, der die in den OGAW-Vorschriften festgelegten Kriterien erfüllt und von der Zentralbank anerkannt ist, dann kann dieser Fonds bis zu 20 % seines Nettovermögens in Anteilen und/oder Schuldtiteln von ein und demselben Emittenten anlegen.
- 4.2. Die unter 4.1 genannte Grenze kann auf 35 % für einen einzelnen Emittenten erhöht werden, sofern dies durch ungewöhnliche Marktbedingungen gerechtfertigt ist.

5. Allgemeine Bestimmungen

- 5.1. Ein Fonds bzw. eine Verwaltungsgesellschaft kann in Verbindung mit allen von ihr verwalteten OGA keine stimmberechtigten Anteile erwerben, welche es ihr ermöglichen würden, wesentlichen Einfluss auf die Verwaltung eines Emittenten zu nehmen.
- 5.2. Ein Teilfonds darf nicht mehr als:

- (i) 10 % der stimmrechtslosen Anteile eines einzelnen Emittenten;
- (ii) 10 % der Schuldtitel eines einzelnen Emittenten;
- (iii) 25 % der Anteile eines einzelnen OGA;
- (iv) 10 % der Geldmarktinstrumente eines einzelnen Emittenten erwerben.

Die unter den vorstehenden Absätze (ii), (iii) und (iv) genannten Grenzen müssen beim Erwerb nicht eingehalten werden, wenn sich der Bruttobetrag der Schuldtitel oder Geldmarktinstrumente oder der Nettobetrag der im Umlauf befindlichen Wertpapiere zum Zeitpunkt des Erwerbs nicht berechnen lässt.

5.3. Die Ziffern 5.1 und 5.2 gelten nicht in Bezug auf:

- (i) Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die von einem Mitgliedstaat oder seinen Gebietskörperschaften begeben oder garantiert sind;
- (ii) Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die von einem Nicht-Mitgliedstaat begeben oder garantiert sind;
- (iii) Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die von internationalen Körperschaften öffentlichen Rechts, denen ein oder mehrere Mitgliedstaaten als Mitglied angehören, begeben sind;
- (iv) Anteile, die von einem Fonds am Vermögen einer in einem Nicht-Mitgliedstaat gegründeten Gesellschaft gehalten werden, die vorwiegend in Wertpapieren von Emittenten anlegt, deren eingetragener Sitz sich in diesem Nicht-Mitgliedstaat befindet, wenn dies nach den Gesetzen dieses Nicht-Mitgliedstaates für den Fonds die einzige Möglichkeit darstellt, in Wertpapieren von in diesem Nicht-Mitgliedstaat ansässigen Emittenten anzulegen. Diese Ausnahmeregelung gilt nur unter der Voraussetzung, dass die Anlagepolitik der Gesellschaft aus dem Nicht-Mitgliedstaat die

in den Ziffern 2.3 bis 2.11, 3.1, 3.2, 5.1, 5.2, 5.4, 5.5 und 5.6 festgelegten Grenzen einhält, und dass, sofern diese Grenzen überschritten werden, die Bestimmungen der nachfolgenden Ziffern 5.5 und 5.6 eingehalten werden.

- (v) Von der Gesellschaft gehaltene Anteile am Kapital von Tochtergesellschaften, die im Niederlassungsstaat der Tochtergesellschaft lediglich und ausschließlich für diese bestimmte Verwaltungs-, Beratungs- und Vertriebstätigkeiten im Hinblick auf die Rücknahme von Anteilen auf Wunsch der Anteilinhaber ausüben.

5.4. Bei der Ausübung von Zeichnungsrechten, die an Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente geknüpft sind, die Teil seines Vermögens sind, muss ein Fonds die hier definierten Anlagebeschränkungen nicht einhalten.

5.5. Die Zentralbank hat jedem Fonds gestattet, von den Bestimmungen der Ziffern 2.3 bis 2.12, 3.1, 3.2, 4.1 und 4.2 für die Dauer von sechs Monaten ab dem Datum der Zulassung der Fonds abzuweichen, sofern der jeweilige Fonds den Grundsatz der Risikostreuung befolgt.

5.6. Werden die vorliegend definierten Grenzen aus Gründen überschritten, die außerhalb der Kontrolle eines Fonds liegen oder aus der Ausübung von Zeichnungsrechten resultieren, muss der Fonds unter angemessener Berücksichtigung der Interessen seiner Anteilinhaber seine Verkaufstätigkeit vorrangig auf die Behebung dieser Situation abstellen.

5.7. Ein Fonds darf keine Leerverkäufe mit folgenden Instrumenten tätigen:

- (i) Wertpapiere
- (ii) Geldmarktinstrumente¹;
- (iii) Anteile von anderen Organismen für gemeinsame Anlagen; oder
- (iv) derivative Finanzinstrumente.

5.8. Ein Teilfonds darf zusätzlich liquide Mittel halten.

¹ Leerverkäufe von Geldmarktinstrumenten durch die Fonds sind verboten.

6. DFI

- 6.1. Das Gesamtengagement eines Fonds (gemäß den OGAW-Vorschriften der Zentralbank) in DFI darf nicht dessen Gesamtnettinventarwert übersteigen.
- 6.2. Das Engagement in den DFI zugrunde liegenden Vermögenswerten, einschließlich eingebetteten DFI in Wertpapieren oder Geldmarktinstrumenten, darf in Kombination mit etwaigen aus Direktanlagen resultierenden Positionen nicht die in den OGAW-Vorschriften der Zentralbank festgelegten Anlagegrenzen überschreiten. Diese Bestimmung gilt nicht im Fall von indexbasierten Finanzderivaten, sofern der zugrunde liegende Index den in den OGAW-Vorschriften der Zentralbank festgelegten Kriterien entspricht.
- 6.3. Ein Fonds kann in DFI investieren, die im OTC gehandelt werden, vorausgesetzt, dass es sich bei den Kontrahenten von OTC-Transaktionen um Institutionen handelt, die einer sachverständigen Überwachung unterliegen und den von der Zentralbank zugelassenen Kategorien angehören.
- 6.4. Die Anlage in DFI unterliegt den von der Zentralbank festgelegten Bedingungen und Einschränkungen.

- 7.4. Ein Fonds darf für vorübergehende Zwecke Kredite in Höhe von bis zu 10 % seines Nettinventarwerts aufnehmen.

7.

- 7.1. Die Gesellschaft kann bewegliche und unbewegliche Güter erwerben, die sie für ihr Geschäft benötigt.
- 7.2. Die Gesellschaft darf keine Edelmetalle oder diese verbriefende Zertifikate erwerben.
- 7.3. Die Gesellschaft darf ihre Vermögenswerte nicht verleihen, unter dem Vorbehalt, dass im Sinne dieser Beschränkung das Halten von zusätzlichen liquiden Vermögenswerten wie etwa Einlagen und der Erwerb von Anleihen, Schuldverschreibungen, Einlagenzertifikaten, Bankakzepten und anderen gemäß den OGAW-Vorschriften zulässigen Schuldtiteln oder Verbindlichkeiten sowie der Erwerb von Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten oder anderen Finanzinstrumenten, die nicht vollständig eingezahlt sind, nicht als Gewährung eines Darlehens betrachtet werden.

Risikoinformationen

Dieser Abschnitt enthält Informationen über einige der allgemeinen Risiken, die mit einer Anlage in den Fonds verbunden sind. Risikoinformationen, die für die einzelnen Fonds besonders relevant sind, sind im maßgeblichen Nachtrag enthalten. Dieser Abschnitt soll keine vollständige Erläuterung darstellen, und es können von Zeit zu Zeit auch andere Risiken relevant sein. Insbesondere kann die Wertentwicklung der Gesellschaft und jedes einzelnen Fonds von Veränderungen der Markt-, wirtschaftlichen und politischen Bedingungen und der gesetzlichen, aufsichtsrechtlichen und steuerlichen Anforderungen beeinflusst werden.

Anleger sollten sich bewusst sein, dass sich eine Anlage in einem Fonds von einer Einlage auf einem Bankkonto unterscheidet und nicht durch staatliche, behördliche oder sonstige Sicherungssysteme geschützt ist.

Potenzielle Anleger sollten, bevor sie eine Entscheidung in Bezug auf eine Anlage in einem Fonds treffen, alle in diesem Prospekt und dem maßgeblichen Nachtrag enthaltenen Informationen sowie ihre eigenen persönlichen Umstände sorgfältig abwägen und ihren eigenen Börsenmakler, Bankberater, Anwalt, Wirtschaftsprüfer und/oder Finanzberater konsultieren. Eine Anlage in den Anteilen eines Fonds ist nur für Anleger geeignet, die (entweder alleine oder zusammen mit einem geeigneten Finanz- oder sonstigem Berater) in der Lage sind, die Vorteile und Risiken einer solchen Anlage zu beurteilen, und die über ausreichend Ressourcen verfügen, um Verluste, die daraus resultieren können, zu tragen.

Der Preis der Anteile eines Fonds kann sowohl sinken als auch steigen, und ihr Wert ist nicht garantiert. Anteilinhaber erhalten möglicherweise bei Rückgabe oder Liquidation nicht den Betrag zurück, den sie ursprünglich in einen Fonds investiert haben, bzw. möglicherweise auch gar nichts.

Wesentliche Risiken

Risiken im Zusammenhang mit liquiden Mitteln. Ein Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen wesentlichen Anteil seiner Vermögenswerte in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten halten. Verfügt ein Fonds über einen längeren Zeitraum hinweg über erhebliche Barbestände, kann dies die Anlagerenditen beeinträchtigen und er kann möglicherweise sein Anlageziel nicht erreichen.

Risiko bei Rohstoffen. Rohstoffpreise werden u.a. von diversen makroökonomischen Faktoren beeinflusst, wie z. B. durch eine wechselnde Angebots-Nachfrage-Situation, Wetterbedingungen und andere Naturphänomene, landwirtschaftliche, Handels-, Finanz-, geldpolitische und Börsenkontrollprogramme und Regierungspolitik (einschließlich staatlicher Interventionen in bestimmten Märkten) sowie andere nicht vorhersehbare Ereignisse. Die Absicht eines Fonds in Rohstoffe zu investieren, wird im maßgeblichen Nachtrag angegeben.

Konzentrationsrisiko. Ein Fonds kann einen relativ hohen Anteil seines Vermögens in Emittenten investieren, die in einem einzelnen Land, einer kleinen Anzahl von Ländern oder in einer bestimmten geographischen Region ansässig sind. In solchen Fällen ist die Wertentwicklung des Fonds mit den Markt-, Währungs-, wirtschaftlichen, politischen oder aufsichtsrechtlichen Bedingungen und Entwicklungen in

diesem Land, bzw. diesen Ländern oder dieser Region verknüpft und kann volatiler sein als die Wertentwicklung von geographisch stärker diversifizierten Fonds.

Darüber hinaus kann ein Fonds seine Anlagen auf Unternehmen oder Emittenten in einer bestimmten Branche, einem bestimmten Markt oder einem bestimmten Wirtschaftssektor konzentrieren. Konzentriert ein Fonds seine Anlagen in einer bestimmten Branche, einem bestimmten Markt oder einem bestimmten Wirtschaftssektor, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Branche, diesem Markt oder diesem Sektor betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds und könnten das Volatilitätsniveau des Fonds möglicherweise erhöhen als dies der Fall wäre, wenn seine Vermögenswerte nicht in dieser Branche, diesem Markt oder diesem Wirtschaftssektor konzentriert wären. Die Liquidität des Fonds kann durch solch eine Investitionskonzentration ebenfalls beeinträchtigt werden.

Zudem können Anleger in Reaktion auf Faktoren, die ein bestimmtes Land, eine Branche, einen Markt oder Wirtschaftssektor beeinflussen, in denen der Fonds seine Anlagen konzentriert, große Mengen von Anteilen eines Fonds kaufen oder verkaufen, was zu ungewöhnlich hohen Zuflüssen oder Abflüssen von Liquidität in bzw. aus dem Fonds führen kann. Diese außergewöhnlichen Zuflüsse oder Abflüsse können dazu führen, dass die Liquidität des Fonds bzw. der Liquiditätsbedarf über das normale Niveau hinausgeht, und dementsprechend die Verwaltung des Fonds und die Wertentwicklung des Fonds negativ beeinflussen.

Risiko von Interessenkonflikten. Interessenkonflikte können im Zusammenhang mit einer Anlage in die Gesellschaft entstehen. Gemäß geltendem Recht kann die Gesellschaft Geschäfte tätigen, die einen potenziellen Interessenkonflikt auslösen oder dazu führen können. Zu diesen Geschäften gehören unter anderem:

- Der Anlageverwalter oder seine Konzerngesellschaften können für die Gesellschaft Dienstleistungen erbringen, wie z.B. Dienstleistungen als Lending Agent, Depot-, Verwaltungs-, Buchführungs-, und Rechnungslegungsdienste, Dienste als Transferstelle und in der Betreuung der Anteilinhaber und sonstige Dienstleistungen.
- Die Gesellschaft kann mit oder über den Anlageverwalter oder eine seiner Konzerngesellschaften Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und Derivatetransaktionen abschließen.
- Die Gesellschaft kann in andere Pool-Anlageinstrumente investieren, die vom Anlageverwalter gesponsert oder verwaltet werden oder anderweitig mit dem Anlageverwalter verbunden sind. In diesem Fall darf der Gesellschaft für diese Anlagen keine Zeichnungs- oder Rücknahmegebühr berechnet werden, aber die Gesellschaft trägt einen Anteil der Kosten dieser anderen Pool-Anlageinstrumente. Diese Anlageinstrumente können Gebühren und andere Beträge an den Anlageverwalter oder seine Konzerngesellschaften zahlen, durch die sich die

Kosten der Gesellschaft möglicherweise erhöhen. Es ist möglich, dass andere Kunden des Anlageverwalters Anteile an solchen anderen Pool-Anlageinstrumenten zu günstigeren Preisen und Zeitpunkten kaufen oder verkaufen als die Gesellschaft.

Es kann nicht gewährleistet werden, dass die Sätze, zu denen die Gesellschaft Gebühren und Kosten an den Anlageverwalter oder seine Konzerngesellschaften zahlt, oder die Konditionen, zu denen sie Transaktionen mit dem Anlageverwalter oder seinen verbundenen Unternehmen tätigt oder in solche anderen Anlageinstrumente investiert, allgemein die günstigsten am Markt erhältlichen sind oder so günstig sind wie die, die der Anlageverwalter anderen Kunden anbietet. Es gibt keine unabhängige Überwachung von Gebühren oder Kosten, die an diese Stellen gezahlt werden oder Dienstleistungen, die von diesen Stellen erbracht werden. Wegen seines finanziellen Interesses hat der Anlageverwalter möglicherweise einen Anreiz, im Namen der Gesellschaft Transaktionen oder Verträge mit sich selbst oder seinen Konzerngesellschaften unter Umständen abzuschließen, unter denen er es bei Nichtvorliegen dieses Interesses möglicherweise nicht getan hätte. Transaktionen und Dienstleistungen mit oder über den Anlageverwalter oder seine Konzerngesellschaften werden jedoch in Einklang mit den anwendbaren aufsichtsrechtlichen Bestimmungen getätigt bzw. erbracht.

Der Anlageverwalter und seine Konzerngesellschaften fungieren als Anlageberater für andere Kunden und können Anlageentscheidungen für eigene Rechnung und für Rechnung Dritter, unter anderem auch für andere Fonds, treffen, die von den Entscheidungen, die der Anlageverwalter im Namen der Gesellschaft trifft, abweichen. Insbesondere kann der Anlageverwalter Kunden im Hinblick auf die Vermögensallokation beraten und dabei auch Empfehlungen erteilen, in einen Fonds zu investieren oder Fondanteile zu verkaufen, während er nicht allen Kunden, die in denselben oder ähnlichen Fonds investiert sind, dieselbe Empfehlung erteilt.

Weitere Konflikte können beispielsweise entstehen, wenn Kunden des Anlageverwalters in verschiedene Teile der Kapitalstruktur eines Emittenten investieren, so dass eine oder mehrere Kunden erstrangige Schuldtitel eines Emittenten halten und andere Kunden nachrangige Schuldtitel desselben Emittenten. Auch können unter Umständen Kunden in verschiedene Tranchen desselben strukturierten Finanzierungsinstrumentes investieren. Unter solchen Umständen können Entscheidungen, ob ein Verzugsereignis geltend gemacht wird oder Entscheidungen über die Bedingungen einer Abwicklung zu Interessenskonflikten führen. Im Falle von Anlageentscheidungen, bei denen ein Interessenkonflikt entstehen kann, wird sich der Anlageverwalter bemühen, in Einklang mit seinen Richtlinien für Interessenkonflikte zwischen dem betreffenden Fonds und anderen Kunden angemessen und gerecht vorzugehen. Vorbehaltlich des Vorgenannten können (i) der Anlageverwalter und seine Konzerngesellschaften für eigene Rechnung und für Rechnung von Kunden in verschiedene Wertpapiere investieren, die gegenüber den Wertpapieren, die von der Gesellschaft gehalten werden, vorrangig, gleichrangig oder nachrangig sind, und (ii) kann der Anlageverwalter zu bestimmten Zeitpunkten (vorbehaltlich der anwendbaren Gesetze) gleichzeitige Käufe (oder Verkäufe) von Anlagen

für die Gesellschaft und Verkäufe (oder Käufe) derselben Anlage für Depots, Fonds oder strukturierte Produkte, für die er jetzt oder in Zukunft als Vermögensverwalter fungiert, oder für seine Kunden oder verbundenen Unternehmen tätigen und unter solchen Umständen Kompensationsgeschäfte tätigen. Darüber hinaus können der Anlageverwalter und seine Konzerngesellschaften Wertpapiere von der Gesellschaft kaufen bzw. an die Gesellschaft verkaufen, wenn dies nach den geltenden Gesetzen zulässig ist. Diese sonstigen Beziehungen können auch dazu führen, dass Beschränkungen der Wertpapiergesetze bezüglich Transaktionen in diesen Instrumenten durch die Gesellschaft und anderweitig potenzielle Interessenkonflikte für den Anlageverwalter verursachen.

Der Anlageverwalter kann im Zusammenhang mit seinen sonstigen geschäftlichen Tätigkeiten, wesentliche nicht-öffentliche vertrauliche Informationen erhalten, durch die der Anlageverwalter in seinen Möglichkeiten, für sich selbst oder seine Kunden (einschließlich der Gesellschaft) Wertpapiere zu kaufen oder zu verkaufen oder anderweitig diese Informationen zum Nutzen seiner Kunden unter zu seinem eigenen Nutzen zu verwenden, eingeschränkt sein kann.

Es ist der Verwahrstelle, der Verwaltungsgesellschaft bzw. den mit diesen Parteien verbundenen Unternehmen nicht untersagt, mit Vermögenswerten der Gesellschaft zu handeln, vorausgesetzt, dass diese Transaktionen zu üblichen Bedingungen im besten Interesse der Anteilinhaber getätigt werden. Zulässige Transaktionen zwischen dem Fonds und solchen Parteien bedürfen (i) einer zertifizierten Bewertung durch eine von der Verwahrstelle (oder der Verwaltungsgesellschaft im Falle einer Transaktion, an der die Verwahrstelle oder ein verbundenes Unternehmen der Verwahrstelle beteiligt ist) als unabhängig und kompetent genehmigte Person; oder (ii) einer Durchführung zu den besten Konditionen an organisierten Börsen gemäß deren Bestimmungen; oder (iii) wenn (i) und (ii) nicht durchführbar sind, der Ausführung zu Konditionen, die nach dem Urteil der Verwahrstelle (bzw. der Verwaltungsgesellschaft im Falle einer Transaktion, an der die Verwahrstelle oder ein verbundenes Unternehmen der Verwahrstelle beteiligt ist) den oben dargelegten Grundsätzen entsprechen. Die Verwahrstelle (oder die Verwaltungsgesellschaft im Falle einer Transaktion, an der die Verwahrstelle oder ein verbundenes Unternehmen der Verwahrstelle beteiligt ist), dokumentiert, wie sie die vorstehenden Punkte (i), (ii) oder (iii) erfüllt hat. Sofern Transaktionen gemäß Punkt (iii) durchgeführt werden, dokumentiert die Verwahrstelle (oder die Verwaltungsgesellschaft im Falle einer Transaktion, an der die Verwahrstelle oder ein verbundenes Unternehmen der Verwahrstelle beteiligt ist) die Gründe, weshalb sie davon überzeugt ist, dass die Transaktion den in diesem Absatz beschriebenen Grundsätzen entsprochen hat.

Es ist der Verwahrstelle, dem Administrator, dem Anlageverwalter oder anderen, der Gesellschaft nahe stehenden Parteien nicht untersagt, als „kompetente Person“ zwecks Ermittlung des wahrscheinlichen Veräußerungswerts einer Anlage des Fonds gemäß den im Abschnitt **„Ermittlung des Nettoinventarwerts“** weiter unten beschriebenen Bewertungsbestimmungen tätig zu sein. Anleger sollten jedoch beachten, dass in Fällen, in denen von der Gesellschaft an diese Parteien Gebühren zu zahlen sind, ein Interessenskonflikt entstehen kann, da diese Gebühren bei einem Anstieg des Nettoinventarwerts

steigen. Jede dieser Parteien ist bestrebt sicherzustellen, dass diese Konflikte gerecht und im besten Interesse der Anteilhaber gelöst werden. Der Anlageverwalter muss bei der Ausführung von Aufträgen oder der Übermittlung von Aufträgen im Namen der Gesellschaft die bestmögliche Ausführung bieten. Der Anlageverwalter unternimmt sämtliche hinreichenden Schritte, um bei der Ausführung oder Übermittlung von Aufträgen im Namen der Gesellschaft das bestmögliche Ergebnis für die Gesellschaft zu erzielen; dabei berücksichtigt er Faktoren wie Preis, Kosten, Schnelligkeit, Wahrscheinlichkeit der Ausführung und Abwicklung, Auftragsumfang und -art, oder andere für die Ausführung des Auftrags maßgebliche Überlegungen. Bei der Ausführung oder Übermittlung von Aufträgen im Namen der Gesellschaft berücksichtigt der Anlageverwalter spezifische Anweisungen des Verwaltungsrats oder seines ordnungsgemäß bevollmächtigten Vertreters bezogen auf die Auftragsausführung.

Ein Verwaltungsratsmitglied kann Transaktionen oder Vereinbarungen mit der Gesellschaft bzw. Transaktionen oder Vereinbarungen, welche die Belange der Gesellschaft berühren, abschließen, sofern er dem Verwaltungsrat vor Abschluss solcher Transaktionen oder Vereinbarungen Art und Umfang seiner wesentlichen Eigeninteressen daran offen gelegt hat. Die Verwaltungsratsmitglieder sind bestrebt sicherzustellen, dass Interessenkonflikte gerecht gelöst werden.

Das Vorstehende stellt keine umfassende Aufzählung oder vollständige Erläuterung aller potenziellen Interessenkonflikte dar, die sich auf die Gesellschaft auswirken können. Die Gesellschaft kann auf Umstände stoßen oder Geschäfte eingehen, bei denen Interessenkonflikte entstehen können, die hier nicht aufgeführt oder erörtert sind.

Kosten des Kaufs oder Verkaufs von ETF-Anteilen.

Anleger, die ETF-Anteile auf dem Sekundärmarkt kaufen oder verkaufen, zahlen Maklergebühren oder andere Gebühren, die vom jeweiligen Makler festgelegt und erhoben werden. Maklergebühren werden oftmals als Fixbetrag berechnet und können für Anleger, die relativ kleine Mengen von ETF-Anteilen kaufen oder verkaufen möchten, verhältnismäßig hohe Kosten bedeuten. Darüber hinaus entstehen Anlegern am Sekundärmarkt die Kosten der Differenz zwischen dem Preis, den ein Anleger für die ETF-Anteile zu zahlen bereit ist (der „**Geldkurs**“) und dem Preis, zu dem ein Anleger bereit ist, die ETF-Anteile zu verkaufen (der „**Briefkurs**“). Diese Differenz zwischen Geld- und Briefkursen wird häufig als „**Spread**“ oder „**Geld/Brief-Spanne**“ bezeichnet. Die Geld/Brief-Spanne für ETF-Anteile schwankt im Laufe der Zeit in Abhängigkeit vom Handelsvolumen und der Marktliquidität und ist im Allgemeinen niedriger, wenn die ETF-Anteile eines Fonds ein höheres Handelsvolumen und eine höhere Marktliquidität aufweisen, und höher, wenn die ETF-Anteile eines Fonds ein geringes Handelsvolumen und eine geringe Marktliquidität haben. Auch eine erhöhte Marktvolatilität kann eine Erhöhung der Geld/Brief-Spannen zur Folge haben. Aufgrund der Kosten für den Kauf oder Verkauf von ETF-Anteilen, einschließlich der Geld/Brief-Spannen, kann ein häufiger Handel mit ETF-Anteilen die Anlageergebnisse erheblich schmälern, und eine Anlage in ETF-Anteilen ist für Anleger, die regelmäßig relativ kleine Mengen handeln möchten, möglicherweise nicht empfehlenswert.

Kontrahentenrisiko. Die Fonds sind in Hinsicht auf die

Kontrahenten, mit denen die Gesellschaft im Namen eines Fonds Derivatekontrakte, Devisenkontrakte, Devisenterminkontrakte und andere Transaktionen, wie Pensionsgeschäfte oder umgekehrte Pensionsgeschäfte und Wertpapierleihgeschäfte abschließt, einem Kreditrisiko ausgesetzt. Wird ein Kontrahent zahlungsunfähig oder kommt er anderweitig seinen Verpflichtungen nicht nach, kann es für einen Fonds bei der Beitreibung in einem Insolvenz-, Konkurs- oder sonstigem Refinanzierungsverfahren zu erheblichen Verzögerungen kommen, und möglicherweise kann er unter solchen Umständen Forderungen nur begrenzt oder gar nicht Beitreiben. Wird das Kreditrating eines Kontrahenten zu einem Derivatgeschäft oder eines potenziellen Kontrahenten zu einem Derivatgeschäft herabgestuft, kann die Gesellschaft außerdem entscheiden, zukünftig keine Transaktionen mehr mit diesem Kontrahenten im Namen eines Fonds zu tätigen, und/oder sie kann Transaktionen, die aktuell zwischen dem Fonds und dem Kontrahenten noch offen sind, kündigen. Alternativ hierzu kann die Gesellschaft nach freiem Ermessen entscheiden, dass sie im Namen des Fonds neue Transaktionen mit dem Kontrahenten abschließt und/oder bestehende Transaktionen weiterführt. In diesem Fall wäre der Fonds in Hinsicht auf diesen Kontrahenten einem höheren Kreditrisiko ausgesetzt. Aufsichtsrechtliche Änderungen, die innerhalb der USA und außerhalb der USA in Kraft treten oder von Aufsichtsbehörden vorgeschlagen werden, können dazu führen, dass sich bestimmte Kontrahentenrisiken im Zusammenhang mit Transaktionen im Freiverkehr, die ein Fonds eingeht, erhöhen.

Nach geltendem Recht oder vertraglichen Bestimmungen, einschließlich Fällen, in denen ein Fonds eine Anlage oder Transaktion mit einem Finanzinstitut abschließt und dieses Finanzinstitut (oder eine Tochtergesellschaft des Finanzinstituts) in finanzielle Schwierigkeiten gerät, kann der Fonds unter bestimmten Umständen seine Rechte zur Kündigung der Anlage oder Transaktion oder zur Verwertung von Sicherheiten eventuell nur mit Verzögerung oder gar nicht ausüben, was dazu führen kann, dass die Zahlungs- und Lieferverpflichtungen der Parteien im Rahmen dieser Anlage oder Transaktion ausgesetzt werden oder dass ein anderes Institut ohne Zustimmung des Fonds dieses Finanzinstitut ersetzt. Darüber hinaus kann der Fonds nach geltendem Recht dem „**Risiko der Verlustbeteiligung**“ („**Bail-in-Regelung**“) ausgesetzt sein. Dies bedeutet, dass die Verbindlichkeiten des Finanzinstituts gemäß Vorschriften der jeweiligen Aufsichtsbehörde des Finanzinstituts abgeschieden, eliminiert oder in Eigenkapital oder ein alternatives Eigentumsinstrument umgewandelt werden könnten. Eine derartige Verlustbeteiligung an einem Finanzinstitut kann zu einer Wertminderung einiger oder aller seiner Wertpapiere führen, und ein Fonds, der solche Wertpapiere hält oder eine Transaktion mit einem solchen Finanzwert abgeschlossen hat, kann ebenfalls in ähnlicher Weise betroffen sein, sollte es zu einer solchen Verlustbeteiligung kommen.

Währungsabsicherungsrisiko. Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die

Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Währungsrisiko. Ein Fonds kann in Wertpapieren anlegen, die auf andere Währungen als die Basiswährung des Fonds lauten. Wertveränderungen dieser Währungen gegenüber der Basiswährung eines Fonds können positive oder negative Auswirkungen auf den Wert der Anlagen des Fonds, die auf diese Währungen lauten, haben. Ein Fonds kann, muss aber nicht in Devisentermingeschäfte investieren, um das Risiko in Bezug auf unterschiedliche Währungen zu reduzieren. Es kann jedoch nicht gewährleistet werden, dass diese Geschäfte ihren Zweck erfüllen. Auch können diese Geschäfte die Vorteile, die einem Fonds aus günstigen Wechselkursschwankungen entstehen, ganz oder teilweise eliminieren.

Die Werte anderer Währungen können gegenüber der Basiswährung eines Fonds schwanken, unter anderem als Reaktion auf Zinsänderungen, Interventionen (oder des Ausbleibens von Interventionen) durch nationale Regierungen, Zentralbanken oder supranationale Organisationen wie den Internationalen Währungsfonds, die Auferlegung von Devisenkontrollen und andere politische oder regulatorische Entwicklungen. Devisenwerte können sowohl kurzfristig als auch langfristig als Reaktion auf diese und andere Entwicklungen deutlich fallen. Die andauernde Ungewissheit bezüglich der Lage des Euros und der Europäischen Währungsunion (die „EMU“) hat generell zu einer beträchtlichen Volatilität auf Devisen- und Finanzmärkten geführt. Eine teilweise oder komplette Auflösung der EWU oder eine andauernde Ungewissheit in Bezug auf ihre Lage könnte beträchtliche nachteilige Auswirkungen auf Devisen- und Finanzmärkte und auf die Werte der Portfolioanlagen eines Fonds haben.

Verwahrungsrisiko. Die Geschäfte mit Verwahrstellen oder Maklern, die Transaktionen eines Teilfonds halten oder abrechnen, sind mit Risiken verbunden. Es ist möglich, dass im Falle der Insolvenz oder des Konkurses einer Verwahrstelle oder eines Maklers ein Teilfonds seine Vermögenswerte mit Verzögerung oder gar nicht von der Verwahrstelle oder dem Makler bzw. aus deren Konkursmasse zurückerhält, und er hat möglicherweise für diese Vermögenswerte nur eine allgemeine, ungesicherte Forderung gegenüber der Verwahrstelle oder dem Makler. Die Verwahrstelle hält Vermögenswerte gemäß den geltenden Gesetzen und den im Verwahrstellenvertrag vereinbarten Bestimmungen. Diese Anforderungen dienen dazu, die Vermögenswerte im Falle einer Insolvenz der Verwahrstelle zu schützen, aber es gibt keine Garantie dafür, dass dieser Schutz erfolgreich ist. Siehe auch „Risiken im Zusammenhang mit internationalen Anlagen“.

Derivaterisiko. Die Fonds können derivative Instrumente für Zwecke des effizienten Portfoliomanagements und für Anlagezwecke einsetzen. Im maßgeblichen Nachtrag eines jeden Fonds wird angegeben, wie der Fonds beabsichtigt, derivative Instrumente einzusetzen. Der Einsatz von derivativen Instrumenten durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind. Diese Risiken beinhalten:

- potenzielle Wertveränderungen in Reaktion auf

Zinsänderungen oder andere Marktentwicklungen oder aufgrund der Bonität des Kontrahenten;

- die Möglichkeit, dass die Derivatetransaktionen nicht die vom Anlageverwalter erwartete Wirkung hat;
- das Versäumnis des Kontrahenten der Derivatetransaktion, seine Verpflichtungen aus der Transaktion zu erfüllen oder eine Transaktionen abzurechnen (siehe auch „Kontrahentenrisiko“);
- mögliche Fehlbewertungen oder unangemessene Bewertungen eines derivativen Instruments;
- eine unvollständige Korrelation im Wert eines Derivats mit dem Vermögenswert, Zinssatz oder Index, der dem Derivat zugrunde liegt;
- die spezifischen mit dem Basisinstrument des Derivats verbundenen Risiken;
- eine mögliche Erhöhung der von Anteilhabern zahlbaren Steuern und der Zeitpunkt dieser Steuerzahlungen;
- eine mangelnde Liquidität für das derivative Instrument, wenn dafür kein Sekundärmarkt vorhanden ist;
- die Möglichkeit einer Schmälerung der Renditen eines Fonds aufgrund von Verlusten aus der Transaktion und einer Erhöhung der Volatilität; und
- rechtliche Risiken, die sich aus der Form des Vertrages ergeben, der zur Dokumentation des Derivatehandels verwendet wurde.

Bei Investitionen in bestimmte derivative Instrumente, kann ein Fonds mehr als den Nennbetrag des Instrumentes verlieren. Darüber hinaus können manche Derivatetransaktionen eine Hebelwirkung hervorrufen und hoch volatil und spekulativ sein.

Ferner wird von einem Fonds, der in ein derivatives Instrument investiert, möglicherweise keine Sicherheitsleistung in Höhe des Betrages des derivativen Instruments verlangt. Die vom Fonds gehaltenen liquiden Mittel (die in der Regel dem nicht finanzierten Betrag des Derivats entsprechen) werden in der Regel in Geldmarktinstrumente investiert, und die Wertentwicklung des Fonds wird daher von den aus diesen Anlagen erzielten Renditen beeinflusst. Es ist möglich, dass Renditen aus der Anlage dieser liquiden Mittel negative Einflüsse auf die Wertentwicklung und/oder Renditen des Fonds haben.

Risiken im Zusammenhang mit angewiesenem Handel. Auf dem Primärmarkt agierende Anleger können die Ausführung eines Geschäfts, insbesondere den Verkauf oder Kauf von Wertpapieren in ihrem Auftrag, nur gemäß bestimmten Bedingungen beantragen, wozu insbesondere die Nutzung eines bestimmten Maklers, Kontrahenten oder Marktes oder auf eine andere Art und Weise als gemäß den Standardbedingungen gehören können, anhand derer der Anlageverwalter im Allgemeinen unter Berücksichtigung seiner Verpflichtung, der Gesellschaft eine bestmögliche Ausführung zu bieten, Geschäfte für die Gesellschaft ausführt. Wird ein solcher Antrag angenommen, haften weder die Gesellschaft noch ihre Vertreter – zur Klarstellung, einschließlich des Anlageverwalters – für Verluste, Schäden oder Verzögerungen, einschließlich einer Verzögerung bei

der Ausführung oder einer versäumten Ausführung einer Zeichnung oder Rücknahme, die durch eine Unterlassung, einen Fehler, ein nicht zustande gekommenes oder ein verzögertes Geschäft oder eine verzögerte Abwicklung seitens des Anlegers oder des benannten Maklers oder sonstigen Kontrahenten verursacht werden. Sollte der Anleger oder der benannte Makler oder sonstige Kontrahent seine Verpflichtungen in Bezug auf das Geschäft nicht erfüllen oder anderweitig einen Teil des maßgeblichen Geschäfts nicht erfüllen, trägt der Anleger alle damit verbundenen Risiken und Kosten, und die Gesellschaft ist berechtigt, die Bedingungen des Geschäfts (einschließlich der Maklerauswahl) und die Zeichnung oder Rücknahme des Anlegers zu ändern, um diesen Ausfall und/oder diese Nichterfüllung zu berücksichtigen und um das Geschäft abzuschließen.

Risiken im Zusammenhang mit angewiesener Stimmabgabe. Anleger in bestimmten Fonds können jeweils einzelne Vereinbarungen treffen, wonach diese Anleger die Möglichkeit haben, eine Richtlinie zur Stimmrechtsvertretung auszuwählen, die für einen proportionalen Anteil der von dem/den Fonds, an dem/denen ihnen Anteile zugeteilt wurden, gehaltenen Aktien (für die Stimmrechte ausübbar sind) gilt. Diese Anleger haben gegenüber dem/den Fonds keine treuhänderischen Pflichten. Die von einem Anleger ausgewählte Richtlinie zur Stimmrechtsvertretung und die gemäß einer solchen Richtlinie erfolgte Abstimmung für Aktien entsprechen möglicherweise nicht den Belangen und Werten eines oder mehrerer anderer Investoren des/der Fonds oder können diesen sogar zuwiderlaufen.

Sofern Stimmrechte in Bezug auf von einem Fonds gehaltene Aktien gemäß einer solchen Vereinbarung ausgeübt werden, besteht das Risiko, dass die Stimmrechte für diese Aktien abweichend vom Abstimmungsverhalten für andere, äquivalente Aktien, die der Fonds hält, ausgeübt werden. Es gibt keine Garantie, dass für einen proportionalen Anteil der von einem Fonds gehaltenen Aktien gemäß einer Abstimmungsvereinbarung eines teilnehmenden Anlegers abgestimmt wird. Die Verfügbarkeit des Stimmrechtsvertretungsprogramms unterliegt allen geltenden aufsichtsbehördlichen, betrieblichen (einschließlich in Bezug auf Teilstimmrechte), lokalmarktbedingten (einschließlich geltender lokaler Einschränkungen der getrennten Abstimmung), steuerlichen, kostenbedingten oder sonstigen Einschränkungen der Stimmrechtsvertretung durch Dritte oder State Street Investment Management.

Die Verwaltungsgesellschaft oder sonstige Parteien übernehmen keine Gewähr oder Haftung in Bezug auf die Umsetzung einer solchen Abstimmungsvereinbarung, und es wird nicht garantiert, dass die Stimmabgabe entsprechend der Abstimmungsvereinbarung erfolgt. Es besteht das Risiko, dass für einen Teil oder alle diese proportionalen Anteile an Aktien keine Stimme abgegeben wird oder gemäß einer anderen Abstimmungsvereinbarung abgestimmt wird. Ebenso besteht das Risiko, dass der Administrator der Stimmrechtsvertretung durch Dritte die Richtlinie zur Stimmrechtsvertretung für eine Abstimmung anders auslegt, als es der Interpretation der Richtlinie durch den Anleger in Bezug auf diese Abstimmung entspricht.

Je nach der Unternehmensstruktur des Anlegers besteht das Risiko, dass gemäß dem Stimmrechtsvertretungsprogramm über Aktien eines

Unternehmens abgestimmt wird, das zur Unternehmensgruppe des Anlegers gehört.

Die Verwaltungsgesellschaft behält sich das Recht vor, das Stimmrechtsvertretungsprogramm (in Einzelfällen oder allgemein) ganz oder teilweise, auch mit sofortiger Wirkung, auszusetzen oder einzustellen, falls dies durch geltendes Recht oder Aufsichtsrecht vorgeschrieben ist oder falls die Verwaltungsgesellschaft dies aus anderen Gründen für angemessen hält. Dies kann zur Folge haben, dass für Aktien gemäß der Richtlinie zur Stimmrechtsvertretung der Verwaltungsgesellschaft abgestimmt wird, nicht gemäß dem Stimmrechtsvertretungsprogramm.

ESG-Risiko. Die Einbeziehung von ESG-Erwägungen in den Anlageprozess eines Fonds oder die Indexmethodik kann dazu führen, dass der Fonds andere Anlagen tätigt als Fonds, bei denen solche Überlegungen nicht in den Anlageprozess oder die Indexmethodik einfließen. Dies kann Auswirkungen auf die Wertentwicklung des Fonds im Vergleich zu diesen anderen Fonds haben. Unternehmen, in die der Fonds investiert, können verschiedenen Faktoren ausgesetzt sein, die sich auf ihre Geschäftstätigkeit oder ihren Betrieb auswirken können. Beispiele für solche Faktoren sind die Höhe der staatlichen Finanzierung für saubere Energie oder andere Umweltinitiativen, die Auswirkungen der allgemeinen weltweiten Wirtschaftsbedingungen, der verstärkte Wettbewerb durch andere Anbieter von Dienstleistungen, Änderungen an der Steuergesetzgebung oder den Rechnungslegungsgrundsätzen sowie Änderungen an geltenden Gesetzen oder Vorschriften. Der Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter kann sich auf ESG-Daten oder Informationen zu den ESG-Merkmalen eines Unternehmens stützen, die von Dritten bereitgestellt werden und unvollständig, widersprüchlich oder unrichtig sind, was sich auf die Fondsanlagen auswirken kann. Ein Fonds kann in Unternehmen anlegen, in denen sich nicht die Überzeugungen und Werte eines bestimmten Anlegers niederschlagen. Siehe auch **Nachhaltigkeitsrisiko**.

Risiken im Zusammenhang mit Gebühren und Kosten. Ungeachtet der Profitabilität eines Fonds muss er Gebühren und Kosten, einschließlich Gründungs- und Angebotskosten, Maklerprovisionen, Management-, Verwaltungs- und Betriebskosten und Verwahrgebühren zahlen. Ein Teil dieser Kosten kann durch Zinserträge ausgeglichen werden.

Risiken im Zusammenhang mit Finanzinstituten. Einige Anlageinstrumente, die die Fonds kaufen können, werden von Finanzinstituten, wie z. B. Banken und Maklern, emittiert oder verbürgt, oder sind durch Wertpapiere besichert, die von Finanzinstituten emittiert oder verbürgt sind. Änderungen in der Bonität eines dieser Institute können den Wert der vom Fonds gehaltenen Anlageinstrumente beeinträchtigen. Nachteilige Entwicklungen im Bankensektor können zu einer Wertentwicklung eines Fonds führen, die unter der eines Fonds liegt, der breiter über unterschiedliche Branchen gestreut ist oder ein geringeres Engagement in Finanzinstituten hat.

Schwankung des Nettoinventarwerts und Marktpreisrisiko. Der Nettoinventarwert je Anteil schwankt in der Regel entsprechend den Veränderungen der Marktwerte der von einem Fonds gehaltenen Wertpapiere. Die Marktpreise von Anteilen schwanken allgemein entsprechend den Veränderungen des Nettoinventarwerts

eines Fonds und dem Angebot von und der Nachfrage nach ETF-Anteilen an der Wertpapierbörse. Es kann nicht vorhergesagt werden, ob ETF-Anteile unter, zu oder über ihrem Nettoinventarwert gehandelt werden. Preisdifferenzen können in hohem Maße dadurch entstehen, dass die Kräfte von Angebot und Nachfrage auf dem Sekundärmarkt für ETF-Anteile eng mit denselben Kräften korrelieren, die die Preise der Wertpapiere eines Index, die individuell oder zusammen zu irgendeinem Zeitpunkt gehandelt werden, beeinflussen, aber nicht identisch mit diesen sind. Die Marktpreise von ETF-Anteilen können in volatilen Marktphasen wesentlich vom Nettoinventarwert je Anteil abweichen. Da ETF-Anteile jedoch in hohem Umfang aufgelegt und zurückgenommen werden können, dürften hohe Abschläge oder Aufschläge auf den Nettoinventarwert je Anteil nicht von großer Dauer sein. Das Ausgabe/Rücknahme-Prinzip soll es zwar wahrscheinlich machen, dass ETF-Anteile normalerweise in etwa zu ihrem Nettoinventarwert gehandelt werden; Störungen bei der Ausgabe und Rücknahme oder deren Aussetzung können jedoch dazu führen, dass die Handelskurse wesentlich vom Nettoinventarwert je Anteil abweichen. Es können Verluste entstehen oder Gewinne geschmälert werden, wenn ETF-Anteile zu einem Zeitpunkt gekauft werden, zu dem der Marktpreis einen Aufschlag gegenüber dem Nettoinventarwert je Anteil aufweist, oder zu einem Zeitpunkt verkauft werden, zu dem der Marktpreis einen Abschlag zum Nettoinventarwert je Anteil aufweist.

Devisenrisiko. Die Gesellschaft kann im Namen des Fonds eine Vielzahl verschiedener Devisengeschäfte tätigen, wie z. B. Devisenterminkontrakte, Spot-Geschäfte, Terminkontrakte, Swaps oder Optionen. Die meisten dieser Transaktionen werden „im Freiverkehr“ abgeschlossen. Der Fonds geht dabei das Risiko ein, dass der Kontrahent möglicherweise nicht dazu in der Lage oder willens ist seinen Verpflichtungen nachzukommen. Außerdem besteht das Risiko ungünstiger oder unerwarteter Veränderungen des Werts der Währungen der zugrunde liegenden Transaktionen. Devisengeschäfte im Freiverkehr sind üblicherweise nicht abgesichert. Ein Fonds kann daher möglicherweise nicht alle oder auch keine der Vermögenswerte, die ihm unter solchen Transaktionen zustehen, im Fall eines Versäumnisses des Kontrahenten Beitreiben. Viele Arten von Währungsgeschäften werden erwartungsgemäß auch nach Einführung der Clearing-Erfordernisse unter den Dodd-Frank Wall Street Reform und Verbraucherschutzgesetzen im Freiverkehr durchgeführt werden. In einigen Märkten bzw. bei bestimmten Währungen kann ein Fonds nach Maßgabe der Gesellschaft gezwungen sein oder sich bereit erklären Devisengeschäfte über eine entsprechende Unterdepotbank der Verwahrstelle abzuschließen. Durch das Eingehen solcher Arrangements im Namen eines Fonds kann die Gesellschaft in einen Interessenkonflikt geraten. Solche Transaktionen, die direkt mit der Unterdepotbank getätigt werden, werden zu einem Kurs durchgeführt, der ausschließlich durch die jeweilige Unterdepotbank festgelegt wird. Dementsprechend kann es sein, dass ein Fonds bei solch einem Währungsgeschäft nicht unbedingt den besten Preis erzielt. Jüngste aufsichtsrechtliche Änderungen in einer Reihe von Ländern können es erforderlich machen, dass bestimmte Währungsgeschäfte einer zentralen Clearingstelle unterstellt werden oder neuen oder höheren Erfordernissen für Sicherheitsleistungen unterliegen. Aufgrund dieser Veränderungen könnten einem Fonds höhere Kosten bei

Währungsgeschäften entstehen und bestimmte Transaktionen sind möglicherweise nicht mehr möglich. Sie können auch zu einem höheren Kreditrisiko des Fonds bei solchen Transaktionen führen.

Risiken im Zusammenhang mit Terminkontrakten (Futures) und Anderen Börsengehandelten Derivaten.

Einige Fonds dürfen Terminkontrakte (Futures) und andere börsengehandelte Derivate kaufen. Die Fähigkeit, Positionen in Terminkontrakten und anderen börsengehandelten Derivaten zu eröffnen und zu schließen, hängt von der Entwicklung und Erhaltung eines liquiden Sekundärmarkts ab. Es kann nicht gewährleistet werden, dass es für einen bestimmten Terminkontrakt oder ein anderes börsengehandeltes Derivat oder zu einem bestimmten Zeitpunkt einen liquiden Sekundärmarkt an einer Börse gibt. Falls es für ein bestimmtes Derivat keinen derartigen Markt gibt, können möglicherweise keine Gattstellungstransaktionen durchgeführt werden, und ein Fonds kann sein Engagement in dem Derivat nicht beenden. Setzt ein Fonds Terminkontrakte oder andere börsengehandelte Derivate für Absicherungszwecke ein, besteht ein Risiko einer unvollständigen Korrelation zwischen den Bewegungen in den Preisen der Derivate und den Bewegungen in den Wertpapieren oder im Index, die bzw. der den Derivaten zugrunde liegt, oder den Bewegungen in den Kursen der Wertpapiere des Fonds, die Gegenstand eines Sicherungsgeschäfts sind. Die Preise von Terminkontrakten und anderen börsengehandelten Derivaten können aus mehreren Gründen nicht vollständig mit den Bewegungen in den Wertpapieren oder im Index, die bzw. der ihnen zugrunde liegt, korrelieren. Einem Fonds entstehen Maklergebühren im Zusammenhang mit seinen Geschäften in börsengehandelten Derivaten. Im Zusammenhang mit seinen Geschäften in Terminkontrakten und anderen börsengehandelten Derivaten muss ein Fonds in der Regel eine Sicherheitsleistung bei seinem jeweiligen Kontrahenten hinterlegen. Im Fall einer Insolvenz des Kontrahenten kann der Fonds die beim Kontrahenten hinterlegte Sicherheitsleistung möglicherweise nicht ganz (oder teilweise) zurückbekommen oder den Wert eines Anstiegs im Preis seiner Positionen realisieren.

Indexrisiko. Die Fähigkeit eines Fonds, eine wesentliche Korrelation zwischen der Wertentwicklung des Fonds und dem Index, den er nach bildet, zu erzielen, kann durch Veränderungen auf den Wertpapiermärkten, Veränderungen in der Zusammensetzung des Index, Zuflüsse in und Abflüsse aus dem Fonds und die Gebühren und Kosten des Fonds beeinflusst sein. Der Fonds wird ungeachtet der aktuellen oder erwarteten Wertentwicklung des Index oder der tatsächlichen Wertpapiere, die den Index bilden, versuchen, die Indexrendite nachzubilden. Außerdem wird ein Fonds im Allgemeinen ein Wertpapier, das in einem Index geführt wird, so lange nicht verkaufen, solange es im Index geführt wird. Dies erfolgt ungeachtet plötzlicher oder erheblicher Kursverluste oder vorhersehbarer wesentlicher Kursverluste dieses Wertpapiers und selbst dann, wenn der Anlageverwalter für ein anderes Kundenkonto oder Portfolio, das dieses Wertpapier hält, eine andere Anlageentscheidung treffen würde. Infolgedessen kann die Wertentwicklung des Fonds schlechter als die eines mit einer aktiven Anlagestrategie verwalteten Portfolios sein. Die Struktur und Zusammensetzung des Index wird sich auf die Wertentwicklung, Volatilität und das Risiko des Index (auf absoluter Basis und im Vergleich mit anderen Indizes) und

damit auf die Wertentwicklung, Volatilität und das Risiko des Fonds auswirken. Die Gesellschaft ist bei der Zusammenstellung eines Anlageportfolios, das einen Ertrag liefert, der in enger Korrelation zu dem des Index steht, möglicherweise nicht erfolgreich. Wie im maßgeblichen Nachtrag angegeben, kann die Gesellschaft auch ein(e) oder mehrere „Screenings“ oder Anlagetechniken zur Selektion oder Beschränkung der Anzahl oder der Arten von Emittenten, die in den Indizes, in die der Fonds möglicherweise investiert, geführt werden, einsetzen. Die Verwendung solcher Screenings oder Techniken kann dazu führen, dass die Wertentwicklung der Anlage unter der des Index liegt und nicht die Ergebnisse liefert, die die Gesellschaft sich verspricht.

Indexfehlerisiko: Wenn ein Fonds das Anlageziel hat, die Wertentwicklung eines Referenzindex nachzubilden, wie er von dem jeweiligen Indexanbieter veröffentlicht wird, besteht das Risiko, dass der Indexanbieter den Index nicht genau zusammenstellt oder berechnet. Obwohl der Indexanbieter Beschreibungen bereitstellt, welche Ziele der Index erreichen soll, gibt der Indexanbieter keine Garantie ab und übernimmt keine Haftung in Bezug auf Fehler im Zusammenhang mit dem Index, einschließlich Fehlern bezogen auf Qualität, Richtigkeit oder Vollständigkeit der Indexdaten, und garantiert nicht, dass der Index der beschriebenen Indexmethodik entsprechen wird. Die Verwaltungsgesellschaft und die mit ihr verbundenen Unternehmen übernehmen keine Gewährleistung oder Garantie für Fehler des Indexanbieters und tragen keine Verantwortung für die Identifizierung oder Korrektur solcher Fehler. Fehler hinsichtlich der Qualität, Richtigkeit und/oder Vollständigkeit der Indexdaten können von Zeit zu Zeit auftreten und können für einen bestimmten Zeitraum nicht identifiziert und korrigiert werden. Gewinne, Verluste oder Kosten, die mit Fehlern des Indexanbieters verbunden sind, werden von dem betreffenden Fonds und seinen Anlegern getragen. Beispielsweise würde ein Fonds, der einen solchen veröffentlichten Index nachbildet, während eines Zeitraums, in dem der Index falsche Bestandteile enthält, ein Marktengagement in Bezug auf diese Bestandteile haben und würde in Bezug auf die Bestandteile, die in den Index hätten aufgenommen werden sollen, ein unterdurchschnittliches Engagement haben. Daher können solche Fehler zu einer negativen oder positiven Auswirkung auf die Wertentwicklung des betreffenden Fonds und seiner Anleger führen. Alle Gewinne aus Fehlern des Indexanbieters, die einen Fonds betreffen, fließen diesem Fonds und seinen Anlegern zu, und alle Verluste, die aus solchen Fehlern des Indexanbieters resultieren, werden von diesem Fonds und seinen Anlegern getragen.

Risiko im Zusammenhang mit der Indexlizenz. Falls in Bezug auf einen Index die der Gesellschaft oder dem Anlageverwalter (oder dessen Gruppenunternehmen) zur Nachbildung oder anderweitigen Nutzung des Index für die Zwecke eines Fonds (falls erforderlich) erteilte Lizenz irgendwann ausläuft, oder diese Lizenz anderweitig umstritten oder beeinträchtigt ist oder endet (gleichgültig aus welchem Grund), kann die Verwaltungsgesellschaft gezwungen sein, den Index durch einen anderen Index zu ersetzen, der seiner Meinung nach im Wesentlichen denselben Markt wie der fragliche Index nachbildet, und den er als geeigneten Index für den maßgeblichen Fonds zur Nachbildung erachtet, und dieser Ersatz oder eine Verzögerung bei diesem Ersatz kann sich nachteilig auf den Fonds auswirken. Falls die Verwaltungsgesellschaft keinen

geeigneten Ersatz für den maßgeblichen Index ermitteln kann, kann der Verwaltungsrat zur Schließung des Fonds gezwungen sein.

Indexnachbildungsrisiko. Es gibt keine Garantie, dass das Anlageziel eines Fonds erreicht wird. Ferner gibt es kein Finanzinstrument, mit dem die Rendite eines Index exakt nachgebildet werden kann. Veränderungen in den Anlagen eines Fonds und Neugewichtungen des maßgeblichen Index können diverse Transaktionskosten (unter anderem im Zusammenhang mit der Abrechnung von Devisentransaktionen), betriebliche Aufwendungen oder Ineffizienzen zur Folge haben, die die Nachbildung eines Index durch einen Fonds beeinträchtigen können. Außerdem wird die Gesamtrendite aus einer Anlage in den Anteilen eines Fonds durch bestimmte Kosten und Aufwendungen reduziert, die bei der Berechnung des betreffenden Index nicht berücksichtigt werden. Im Falle einer vorübergehenden Aussetzung oder Unterbrechung des Handels der Anlagen, die den Index bilden, oder im Falle von Marktunterbrechungen ist unter Umständen eine Neuausrichtung des Anlageportfolios eines Fonds nicht möglich, so dass sich Abweichungen von der Rendite des Index ergeben können.

Risiko internationaler Anlagen; Schwellenländerrisiko. Anlagen in Wertpapieren von Unternehmen in mehreren Ländern und/oder Wertpapieren von Unternehmen mit hohem Engagement in mehreren Ländern können mit zusätzlichen Risiken verbunden sein. Politische, gesellschaftliche und wirtschaftliche Instabilität, die Verhängung von Devisen- oder Kapitalkontrollen oder die Enteignung oder Verstaatlichung von Vermögenswerten in einem Land können in diesem Land dramatische wirtschaftliche Einbrüche verursachen. In bestimmten Ländern sind weniger strikte aufsichtsrechtliche Vorgaben, Bilanzierungsvorschriften und Offenlegungsvorschriften für Emittenten und Märkte üblich. Die Durchsetzung gesetzlicher Rechte kann in manchen Ländern schwierig, kostspielig und langwierig und besonders schwierig gegenüber Regierungen sein. Zu den zusätzlichen Risiken von Anlagen in verschiedenen Ländern zählen Handels-, Abrechnungs-, Verwahrstelle- und andere operative Risiken, die durch unterschiedliche Systeme, Verfahren und Anforderungen in einem bestimmten Land und unterschiedliche Gesetze bezüglich Quellensteuern und anderen Steuern bedingt sind. Aufgrund dieser Faktoren können Anlagen in mehreren Ländern, vor allem aber Anlagen in Schwellenmärkten oder weniger entwickelten Märkten volatil und weniger liquide sein als Anlagen in einem einzelnen Land und sich möglicherweise auf die Wertentwicklung eines Fonds nachteilig auswirken.

Darüber hinaus unterliegt ein Fonds bei Anlagen in Schwellenmärkten einem höheren Verlustrisiko als bei Anlagen in Industriemärkten. Dies lässt sich u.a. auf die folgenden Aspekte zurückführen:

- höhere Marktvolatilität;
- geringere Handelsvolumen und Liquiditätsprobleme;
- begrenzter Wertpapiermarkt;
- Beschränkungen bei Wertpapierkäufen durch ausländische Anleger;
- politische und wirtschaftliche Instabilität;

wirtschaftliche Abhängigkeit von einigen wenigen Industrien oder von internationalem Handel oder Umsätzen aus bestimmten Rohstoffen;

- hohe Inflation, Deflation oder Abwertung von Währungen;
- regulatorische, Finanzberichterstattungs-, Rechnungslegungs- und Offenlegungsstandards können weniger streng als die von entwickelten Ländern sein;
- Abwicklungs- und Verwahrsysteme, die nicht so ausgereift wie die in Industrieländern sind, können zu Verzögerungen bei der Abwicklung und möglicherweise zu „fehlgeschlagenen Abwicklungen“ führen;
- prekäre finanzielle Stabilität von Emittenten (Regierungen inbegriffen);
- größeres Risiko einer Einstellung des Marktbetriebs; und
- mehr staatliche Beschränkungen bei ausländischen Investitionen als man sie normalerweise in Industriemärkten findet.

Die vorgenannten Faktoren können dazu führen, dass die Anlagen eines Fonds volatiler sind als es der Fall wäre, wenn der Fonds in besser entwickelte Märkte investieren würde, und können Verluste für einen Fonds verursachen. Dieses Risiko höherer Volatilität und Verluste kann durch Währungsschwankungen gegenüber der Basiswährung des Fonds noch verstärkt werden.

Risiko im Zusammenhang mit dem Anlagestil –

Geographischer Schwerpunkt VK: Bestimmte Fonds konzentrieren ihre Anlagen auf das Vereinigte Königreich. Es ist daher davon auszugehen, dass ihre Wertentwicklung in einem engen Zusammenhang zu den gesellschaftlichen, politischen und wirtschaftlichen Bedingungen in diesem Land steht, und ein Engagement in Bezug auf damit zusammenhängende Risiken könnte ihre Wertentwicklung stärkeren Schwankungen unterwerfen, als bei Fonds mit einer höheren geographischen Diversifizierung der Anlagen der Fall ist. Das Vereinigte Königreich verfügt über eine der größten Volkswirtschaften Europas, und die USA und andere europäische Länder sind wichtige Handelspartner des Vereinigten Königreichs. Infolge dessen könnte die Wirtschaft des Vereinigten Königreichs von Änderungen an den wirtschaftlichen Bedingungen in den USA und anderen europäischen Ländern betroffen sein. Die Wirtschaft des Vereinigten Königreichs verläuft, gemeinsam mit bestimmten anderen Volkswirtschaften der Europäischen Union, während der jüngsten Finanzkrise eine beträchtliche Schwächung, und einige britische Finanzinstitute erlitten erhebliche Verluste, waren deutlich unterkapitalisiert und mussten von staatlicher Seite unterstützt werden, um zu überleben. Die Wirtschaft des Vereinigten Königreichs ist stark vom Export von Finanzdienstleistungen in die USA und andere europäische Länder abhängig, weshalb eine längerfristige Abschwächung des Sektors der Finanzdienstleistungen negative Auswirkungen auf die britische Wirtschaft haben könnte. Eine anhaltende staatliche Beteiligung oder Kontrolle in bestimmten Sektoren kann den Wettbewerb in bestimmten Sektoren unterdrücken oder negative Auswirkungen auf das Wirtschaftswachstum haben. In der Vergangenheit war das Vereinigte Königreich

das Ziel von Terrorismus. Terroristische Anschläge im Vereinigten Königreich oder gegen britische Interessen im Ausland können an den britischen Finanzmärkten zu Unsicherheit führen und die Performance der Emittenten, in denen der Fonds investiert ist, beeinträchtigen.

Das Vereinigte Königreich hielt am 23. Juni 2016 ein Referendum in Bezug auf seine Mitgliedschaft in der EU (das „**EU-Referendum**“) ab. Nach dem Ergebnis des EU-Referendums verließ das Vereinigte Königreich am 31. Januar 2020 offiziell die EU, befolgt aber weiterhin all EU-Vorschriften und die britischen Handelsbeziehungen bleiben bis zum Ende des Übergangszeitraums am 31. Dezember 2020 unverändert. Es bestehen eine Reihe von Unsicherheiten im Zusammenhang mit der Zukunft des Vereinigten Königreichs und dessen Beziehung zur EU, u. a. die Bedingungen des auszuhandelnden Vertrags in Bezug auf den britischen Austritt aus der EU und von Verträgen, die es bezüglich seiner künftigen Beziehung zur EU aushandelt. Die Verhandlung im Zusammenhang mit der weiteren Beziehung des Vereinigten Königreichs zur EU dürfte mehrere Jahre dauern. Die anhaltende Unsicherheit hinsichtlich der laufenden Beziehung des Vereinigten Königreichs zur EU kann zu Unsicherheit auf den globalen Finanzmärkten führen, und die diesbezüglichen Auswirkungen auf das Vereinigte Königreich, die EU und die globalen Finanzmärkte sind ungewiss, könnten allerdings erheblicher und weitreichender Natur sein.

Risiken im Zusammenhang mit der Volksrepublik China und Großchina.

Ein oder mehrere Fonds können Anlagen in der VRC über ein oder mehrere Zugangsprogramme tätigen. Durch die Nutzung dieser Zugangsprogramme kann der Fonds neuen, unsicheren oder nicht erprobten Regeln und Bestimmungen unterliegen, die von den zuständigen Aufsichtsbehörden eingeführt werden. Zudem können sich die für die Anlage eines Fonds in Unternehmen der VRC geltenden Bestimmungen ändern. Es kann nicht gewährleistet werden, dass die Aufsichtsbehörden der VRC nicht in Zukunft Anforderungen einführen, die die Fähigkeit des betreffenden Fonds, seine Anlage-Allokation umzusetzen, beeinträchtigen, zum Beispiel durch Einführung einer Pflichtallokation nach den maßgeblichen Bestimmungen der VRC (z. B. die Verpflichtung, einen Mindestprozentsatz der Anlagen in der VRC in einen bestimmten Anlagentyp zu investieren). Es kann nicht zugesichert werden, dass das/die Zugangsprogramm(e) nicht abgeschafft werden. Solche Veränderungen können für jeden Fonds, der über ein Zugangsprogramm/Zugangsprogramme in Wertpapiere von Emittenten aus der VRC oder Großchina investiert, negative Folgen haben. Neben den mit Anlagen in Schwellenländern einhergehenden Risiken sollten Anleger solcher Fonds auch die folgenden Risiken berücksichtigen.

Risiken im Zusammenhang mit der Beschränkung von ausländischem Aktienbesitz in der VRC.

Es gibt auf Basis von Schwellenwerten, die unter den Bestimmungen der VRC (in ihrer jeweils gültigen Fassung) festgelegt sind, Beschränkungen hinsichtlich der Gesamtmenge an Aktien, die alle zu Grunde liegenden ausländischen Anleger und/oder ein einzelner ausländischer Anleger an einem in der VRC notierten Unternehmen halten dürfen, und die Möglichkeiten des Fonds (als ausländischer Anleger), Anlagen in chinesischen A-Aktien zu tätigen, werden durch die jeweiligen Schwellenwerte sowie durch die Aktivitäten aller zu Grunde liegenden ausländischen Anleger

beeinflusst. Es wird in der Praxis schwierig sein, die Anlagen eines zugrunde liegenden ausländischen Anlegers zu überwachen, da ein Anleger nach den Gesetzen der VRC Anlagen über verschiedene zulässige Kanäle tätigen kann. Sollte der Bestand eines einzelnen ausländischen Anlegers in einem als chinesische A-Aktie börsennotierten Unternehmens die o. g. Beschränkungen überschreiten, so würde der Anleger aufgefordert, innerhalb einer festgelegten Frist auf Last-in-First-out-Basis seinen überschüssigen Bestand abzubauen. Die SSE/SZSE und die SEHK geben für die betreffenden chinesischen A-Aktien Warnungen heraus oder beschränken Kaufaufträge für diese Aktien, wenn sich der Prozentsatz des gesamten Aktienbesitzes der Obergrenze für den Aktienbesitz durch ausländische Anleger nähert. Eine solche Veräußerung beeinträchtigt die Möglichkeiten des Fonds, Anlagen in chinesischen A-Aktien bzw. über Stock Connect oder das QFI-Regime zu tätigen.

Risiken im Zusammenhang mit der Regelung für kurzfristige Gewinnmitnahmen in der VRC. Laut Wertpapiergesetz der VRC muss ein Großaktionär Gewinne, die er aus dem Kauf und Verkauf von Aktien solcher in der VRC notierter Unternehmen erzielt hat, zurückgeben, wenn beide Transaktionen innerhalb eines Sechsmonatszeitraums stattgefunden haben. Falls ein Fonds durch Anlagen in China-Connect-Wertpapieren Großaktionär wird, so können die Gewinne, die der Fonds aus solchen Anlagen erzielen darf, begrenzt sein, und somit können je nach Umfang der Anlage des Fonds in China-Connect-Wertpapieren die Renditen des Fonds beeinträchtigt werden.

Risiken im Zusammenhang mit der Offenlegung von Zinsen in der VRC. Gemäß den Anforderungen der VRC zur Offenlegung von Zinsen kann ein Fonds, wenn er Großaktionär eines in der VRC notierten Unternehmens wird, dem Risiko unterliegen, dass die Positionen des Fonds zusammen mit den Beständen anderer Personen, wie vorstehend erwähnt, gemeldet werden müssen. Damit können die Positionen des Fonds der Öffentlichkeit bekannt werden. Nach den Gesetzen von Hongkong ist, wenn ein in der VRC gegründetes Unternehmen sowohl H-Aktien hat, die an der SEHK notiert sind, als auch A-Aktien, die an der SSE oder SZSE notiert sind, ein Anleger, der in einem über einen bestimmten Schwellenwert (der von Zeit zu Zeit festgelegt wird) hinausgehenden Umfang an einem solchen in der VRC notierten Unternehmen beteiligt ist, verpflichtet, dies gemäß Teil XV der SFO offenzulegen.

Risiken im Zusammenhang mit Aussetzungen, Beschränkungen und anderen Verzögerungen, die den Handel mit chinesischen A-Aktien beeinflussen. Um die Auswirkungen extremer Volatilität auf den Marktpreis von chinesischen A-Aktien zu mildern, beschränken die SSE und die SZSE derzeit die zulässigen Preisschwankungen von chinesischen A-Aktien während eines Handelstages. Die tägliche Grenze liegt bei 10 % und repräsentiert den Höchstbetrag, um den der Kurs eines Wertpapiers (während der aktuellen Handelssitzung) ausgehend vom Abrechnungskurs des Vortages nach oben oder unten schwanken darf. Das Tageslimit regelt lediglich Kursbewegungen und schränkt nicht den Handel innerhalb des maßgeblichen Limits ein. Das Limit begrenzt jedoch nicht potenzielle Verluste, denn es kann bewirken, dass die Liquidation relevanter Wertpapiere zu einem angemessenen oder wahrscheinlichen Realisationswert dieser Wertpapiere verhindert wird, was bedeutet, dass der betreffende Fonds

ggf. nicht in der Lage ist, ungünstige Positionen zu veräußern. Es kann nicht gewährleistet werden, dass es für eine bestimmte chinesische A-Aktie oder zu einem bestimmten Zeitpunkt einen liquiden Markt an einer Börse gibt.

Saudische FIS-Vorschriften – Allgemeine Risiken. Die Anwendung der saudischen FIS-Vorschriften ist wenig erprobt, und ihre mögliche Anwendung durch die lokale Aufsichtsbehörde ist unklar und ungewiss.

Die saudischen FIS-Vorschriften können sich ohne Vorankündigung ändern, und es ist möglich, dass der Anlageverwalter oder der Unteranlageverwalter seinen Status als Saudi QFI verliert, was sich negativ auf die Fähigkeit eines Fonds auswirken könnte, in Aktien zu investieren, die an der Saudi Stock Exchange notiert sind.

Saudische Beschränkungen für ausländisches Eigentum. Eine Anlage des jeweiligen Fonds in saudischen Aktien ist davon abhängig, ob der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter in der Lage sind, Aktien an der Saudi Stock Exchange zu kaufen und zu verkaufen. Voraussetzung dafür, dass der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter mit in Saudi-Arabien notierten Aktien handeln können, ist, dass keine der vorgeschriebenen Beschränkungen für ausländisches Eigentum überschritten wird. Die saudischen FIS-Vorschriften und das saudische Kapitalmarktgesetz schreiben Saudi QFIs (z. B. einem Fonds (mit Rechtspersönlichkeit)) und deren verbundenen Unternehmen bestimmte Eigentumsbeschränkungen für ausländische Anlagen in Form von verschiedenen maximalen Eigentumsschwellenwerten vor. Ein wesentlicher Schwellenwert ist beispielsweise eine Obergrenze (bei 49%) für ausländisches Eigentum an in Saudi-Arabien notierten Aktien, die für alle Kategorien ausländischer Anleger mit oder ohne Wohnsitz gelten (ausgenommen ausländische strategische Investoren). Die Saudi Stock Exchange veröffentlicht auf ihrer Website laufend Informationen zu diesen Schwellenwerten, um die Saudi QFIs und andere Marktteilnehmer bei der Einhaltung dieser Beschränkungen zu unterstützen. Gemäß dem Saudi Foreign Investment Law (saudisches Gesetz über ausländische Investitionen) sind ausländische Investitionen in bestimmte Sektoren/Aktivitäten verboten (z.B. Immobilienanlagen in den heiligen Städten Mekka und Medina). Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter haben die Flexibilität, im Namen von mehr als einem Saudi QFI in Aktien, die in Saudi-Arabien notiert sind, zu investieren. Daher können sie im Namen von mehreren von ihnen verwalteten Fonds, bei denen es sich jeweils um Saudi QFIs handelt, in Aktien investieren, und diese werden alle in die Berechnung in Bezug auf die Schwellenwerte für ausländisches Eigentum einbezogen. Falls ein maßgebliches Limit für ausländisches Eigentum erreicht oder überschritten wird, könnte dies dazu führen, dass der betreffende Fonds keine zusätzlichen im KSA notierten Aktien mehr kaufen kann. Da es Saudi QFIs nach den derzeit geltenden saudischen FIS-Vorschriften nicht erlaubt ist, auch die letztlich wirtschaftlich berechtigten Eigentümer von in Saudi-Arabien notierten Basiswerten von DFI (wie z.B. Swaps oder Participation Notes), die über den saudischen Swap-Rahmen gehandelt werden, zu sein, ist es zudem unter solchen Umständen dem jeweiligen Fonds nicht möglich, als ein Saudi QFI zusätzlich zu seinen physischen/direkten Positionen ein indirektes/synthetisches

Engagement (z.B. über Swaps oder Participation Notes) in Saudi-Arabien notierten Aktien einzugehen. Dies kann schließlich (i) dazu führen, dass der betreffende Fonds keine weiteren Anteilszeichnungen mehr entgegennehmen kann und dass seine Anteile an einer Börse, an der sie zum Handel zugelassen sind, mit einem erheblichen Auf- oder Abschlag gegenüber ihrem Nettoinventarwert gehandelt werden; und (ii) sich negativ oder positiv auf die Wertentwicklung des betreffenden Fonds (und somit für seine Anteilinhaber) im Vergleich zum Index auswirken.

Die Fähigkeit des Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters, mit in Saudi-Arabien notierten Aktien zu handeln, hängt auch von der Fähigkeit des Anlageverwalters, Unteranlageverwalters und/oder des betreffenden Fonds ab, seinen Status als Saudi QFI aufrechtzuerhalten. Nur Saudi QFIs, welche die in den saudischen FIS-Vorschriften festgelegten Qualifikationskriterien erfüllen und ein Anlagedepot gemäß den Saudi Investment Accounts Instructions (Instruktionen für saudische Anlagedepots) eröffnet haben, können über ihren Anlageverwalter in Aktien investieren, die an der Saudi Stock Exchange notiert sind. Verliert der Anlageverwalter, der Unteranlageverwalter und/oder der betreffende Fonds seinen Status als Saudi QFI oder ändern sich die Gesetze und Bestimmungen so, dass das Saudi-QFI-System dem Anlageverwalter, dem Unteranlageverwalter und/oder dem betreffenden Fonds nicht mehr zur Verfügung steht, wird es für den betreffenden Fonds schwieriger, sein Anlageziel zu erreichen. In diesem Falle kann der betreffende Fonds Techniken anwenden, um in Wertpapiere oder andere Instrumente zu investieren, die nicht im Index vertreten sind, aber ein ähnliches Engagement in der Rendite des Index ermöglichen. Bei diesen Instrumenten kann es sich u. a. um Offshore-Futures, andere börsengehandelte Fonds, die ein ähnliches Engagement bieten, oder um Unfunded Swaps handeln (Vereinbarungen, unter denen eine Gegenpartei sich verpflichtet, dem betreffenden Fonds als Gegenleistung für eine Gebühr die Rendite eines bestimmten Engagements (z. B. des Index) zu zahlen). Dementsprechend besteht ein höheres Risiko eines Tracking Error, was sich negativ oder positiv auf die Wertentwicklung des betreffenden Fonds und seine Anteilinhaber auswirken kann. Die Saudi Capital Market Authority (saudische Kapitalmarktbehörde) kann weitere Beschränkungen für ausländisches Eigentum an Wertpapieren im KSA einführen, die sich negativ auf die Liquidität und Wertentwicklung des betreffenden Fonds auswirken können. Solche Beschränkungen können die Fähigkeit des betreffenden Fonds einschränken, die Aktien eines oder mehrerer in seinem Index vertretenen Unternehmen entsprechend den maßgeblichen Gewichtungen des Index zu kaufen, und somit die Fähigkeit des betreffenden Fonds beeinträchtigen, die Wertentwicklung des Index mit hoher Genauigkeit nachzubilden.

Anlagen in Saudi-Arabien. Das KSA ist derzeit ein Schwellenland. Dementsprechend unterscheidet es sich von den Volkswirtschaften der meisten entwickelten Länder, und Investitionen im KSA können höheren Verlustrisiken unterliegen als Investitionen in entwickelten Märkten. Dies ist neben anderen Faktoren durch politische und wirtschaftliche Instabilität und höhere Beschränkungen für ausländische Investitionen im Vergleich zu verschiedenen entwickelten Märkten bedingt. Hinzu kommt, dass dadurch, dass das Rechtssystem des KSA auf der Scharia basiert und in Kraft getretene Gesetze und Vorschriften enthält, Emittenten von Wertpapieren, in die der betreffende Fonds investiert, anderen Offenlegungs-, Corporate-Governance-,

Rechnungslegungs- und Berichtsstandards unterliegen können als Emittenten in anderen Märkten mit anderen Rechtssystemen. Beispielsweise sind börsennotierte Unternehmen verpflichtet, sich an die Saudi Corporate Governance Regulations („CGR“) zu halten, die verschiedene Bestimmungen als „Richtlinien“ enthalten, jedoch ist die Einhaltung der CGR unter den Emittenten nicht unbedingt einheitlich. Politische Veränderungen, gesellschaftliche Instabilität und negative diplomatische Entwicklungen, die im oder in Bezug auf das KSA eintreten können, könnten zu Wirtschaftssanktionen (z.B. Handelsembargos gegen einen bestimmten Emittenten oder das KSA allgemein), der Verhängung zusätzlicher staatlicher Restriktionen, Enteignung von Vermögenswerten, konfiskatorischer Besteuerung (z. B. erhöhte Verbrauchssteuern auf Produkte, die aus Sicht der Regierung ein erhöhtes Risiko eines sozioökonomischen Schadens für das KSA bergen) oder einer Verstaatlichung einzelner oder aller Indexkomponenten führen. Anleger sollten ferner beachten, dass jede Änderung in der Politik der Regierung und der maßgeblichen Behörden des KSA nachteilige Auswirkungen auf die Wertpapiermärkte im KSA sowie auf die Performance des betreffenden Fonds im Vergleich zum Index haben kann.

Das Rechtssystem des KSA Das Rechtssystem des KSA basiert auf dem Scharia-Recht. Frühere Gerichtsentscheidungen können zu Referenzzwecken herangezogen werden, haben aber keinen Präcedenzwert. Da es nur wenige veröffentlichte Fälle und rechtliche Auslegungen gibt und in jedem Fall das Ergebnis von Fällen, über die denen in der Vergangenheit entschieden wurde, nicht bindend wäre, ist die Auslegung und Durchsetzung der geltenden saudischen Gesetze und Vorschriften mit erheblichen Unsicherheiten behaftet. Darüber hinaus kann im Verlaufe der weiteren Entwicklung des Rechtssystems des KSA und insbesondere der saudischen FIS-Vorschriften nicht garantiert werden, dass Änderungen an diesen Gesetzen und Vorschriften, ihrer Auslegung oder ihrer Durchsetzung keine wesentlichen nachteiligen Auswirkungen für den Geschäftsbetrieb des betreffenden Fonds oder die Fähigkeit des betreffenden Fonds haben werden, in Saudi-Arabien notierte Aktien zu erwerben.

Potenzielles Marktvolatilitätsrisiko. Anleger sollten beachten, dass die Saudi Stock Exchange erst seit kurzem ausländische Investoren zu dem durch die saudischen FIS-Vorschriften eingerichteten System zulässt (auch wenn ausländische Investitionen unter bestimmten Bedingungen schon länger erlaubt sind). Die Marktvolatilität kann erhebliche Kursschwankungen bei an der Saudi Stock Exchange notierten Wertpapieren verursachen, die sich auf den Nettoinventarwert des betreffenden Fonds auswirken würden.

Abrechnungs- und verwandte Risiken. Jeder autorisierte Teilnehmer, der einen Zeichnungsantrag für Anteile des betreffenden Fonds stellt, muss das T+2 Cash Settlement Requirement des KSA (Barabrechnungsanforderung T+2) erfüllen, um den Kauf der zugrunde liegenden KSA-Wertpapiere durch den betreffenden Fonds in Verbindung mit dem Zeichnungsauftrag zu decken, damit der Zeichnungsantrag des autorisierten Teilnehmers gültig ist. Dementsprechend muss jeder autorisierte Teilnehmer, der einen Zeichnungsantrag für Anteile des betreffenden Fonds stellt, einen Zeichnungsbetrag liefern (Barbetrag gemäß Barabrechnungsanforderung T+2, „T+2 Cash Settlement Requirement Cash Amount“), um den Kauf der zugrunde liegenden KSA-Wertpapiere durch den Fonds im

Risiko in Verbindung mit elektronischen Handelsplattformen – Tadawul. Broker im KSA erteilen Handelsaufträge über ein elektronisches System, das mit dem System der Tadawul verbunden ist. Die Nutzung von elektronischen Systemen durch den Broker oder die Tadawul unterliegt dem Risiko von Software-, Hardware- oder Kommunikationsausfällen, die den Kauf der gewünschten Wertpapiere für den betreffenden Fonds

stoppen oder verzögern können.

Handelsverbote. Im Falle einer nicht ausgeführten Kauf- oder Verkaufstransaktion in Bezug auf KSA-Wertpapiere wird eine Gegentransaktion über dasselbe Depot bei der Depotbank für dasselbe KSA-Wertpapier am Markt zurückgewiesen (das „KSA-Handelsverbot“). Daher kann eine Handelsaktivität, die ein KSA-Handelsverbot auslöst, zu einer Verzögerung des Handels führen. Dies kann sich auf die Fähigkeit des betreffenden Fonds auswirken, eine Neugewichtung vorzunehmen, und den Tracking Error erhöhen.

Risiko im Zusammenhang mit Rohstoffen. Der betreffende Fonds kann in saudi-arabische Emittenten investieren, die Schwankungen an bestimmten Rohstoffmärkten ausgesetzt sind. Jede negative Veränderung an den Rohstoffmärkten, die durch Veränderungen in Angebot und Nachfrage bei Rohstoffen, durch Marktereignisse, aufsichtsrechtliche Entwicklungen oder andere Faktoren verursacht wird, welche der Fonds nicht beeinflussen kann, könnte negative Auswirkungen für diese Unternehmen haben.

Verstaatlichungsrisiko. Investitionen in Saudi-Arabien können Verlusten durch Enteignung oder Verstaatlichung von Vermögenswerten und Eigentum oder die Verhängung von Beschränkungen für ausländische Investitionen und Kapitalrückführungen ausgesetzt sein.“

Weitere Risiken

Anlagerisiko. Ein Anteilinhaber kann das gesamte in einen Fonds investierte Kapital verlieren. Der Wert von in einem Fonds gehaltenen Wertpapieren kann steigen oder fallen, und dies bisweilen schnell und unerwartet. Eine Anlage in einem Fonds kann zu jedem Zeitpunkt in der Zukunft weniger wert sein als der ursprünglich angelegte Betrag.

Emittentenrisiko. Der Wert von Wertpapieren, die ein Fonds erworben hat, kann aus verschiedenen Gründen sinken, die unmittelbar im Zusammenhang mit den Emittenten dieser Wertpapiere stehen. Hierzu zählen beispielsweise die Management-Wertentwicklung, Verschuldung und eine sinkende Nachfrage nach den Waren und Dienstleistungen des Emittenten.

Leverage-Risiko. Bestimmte Transaktionen, wie z.B. Käufe auf „when-issued“-Basis (Handel bei Erscheinen), „delayed-delivery“-Basis (hinausgeschobene Lieferung), „forward commitment“-Basis (Terminzusage), Verleih von Wertpapieren im Portfolio und der Einsatz von bestimmten Derivaten, kann in einer Hebelwirkung (Leverage) resultieren. Das Leverage bewirkt im Allgemeinen eine Erhöhung der Verlust- oder Gewinnbeträge, die ein Fonds realisieren könnte, und die Wahrscheinlichkeit einer höheren Volatilität des Portfoliowerts eines Fonds. Bei Transaktionen unter Einsatz von Hebelprodukten können relativ geringe Marktbewegungen oder Veränderungen bei anderen zugrunde liegenden Indikatoren zu erheblich höheren Verlusten des Fonds führen, da die Hebelwirkung generell die Auswirkungen von Kursgewinnen bzw. von Kursverlusten der zugrunde liegenden Vermögenswerte eines Fonds verstärken oder ein Investmentrisiko in Hinsicht auf die größere Basis an Vermögenswerten schafft, über die ein Fonds andernfalls nicht verfügen würde.

Risiken durch begrenztes Anlageprogramm. Eine Anlage in einem Fonds oder sogar in einer Kombination aus Fonds ist nicht als vollständiges Anlageprogramm vorgesehen, sondern vielmehr als Anlage im Rahmen eines

diversifizierten Anlageportfolios. Anleger sollten im Hinblick auf die Rolle, die eine Anlage in einem der Fonds in ihrem Gesamtanlageprogramm spielt, ihre eigenen Berater konsultieren.

Liquiditätsrisiko. Bestimmte Anlagen und Anlagentypen unterliegen Weiterverkaufsbeschränkungen, werden im Freiverkehr oder in begrenzten Volumen gehandelt oder haben möglicherweise keinen aktiven Handelsmarkt. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Es kann für einen Fonds schwierig sein, illiquide Wertpapiere exakt zu bewerten. Möglicherweise ist es einem Fonds auch nicht möglich, zu einem günstigen Zeitpunkt oder Preis oder zu Preisen, die den vom Fonds aktuell ermittelten Bewertungen nahe kommen, illiquide Wertpapiere zu verkaufen oder Derivatetransaktionen glattzustellen. Illiquide Wertpapiere können zudem mit höheren Registrierungskosten und anderen Transaktionskosten verbunden sein als liquide Wertpapiere. Jeder Einsatz der im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik“ beschriebenen Techniken eines effizienten Portfoliomanagements kann sich auch nachteilig auf die Liquidität eines Fondsportfolios auswirken und wird vom Anlageverwalter bei der Steuerung des Liquiditätsrisikos des Fonds berücksichtigt.

Gelegentlich kann es vorkommen, dass die Kontrahenten, mit denen ein Fonds Geschäfte abschließt, nicht länger als Market Maker auftreten oder die Kurse von einigen Instrumenten, in denen ein Fonds angelegt hat, nicht mehr quotieren. In diesen Fällen ist ein Fonds unter Umständen nicht in der Lage, ein gewünschtes Geschäft oder ein Glattstellungsgeschäft in Bezug auf eine offene Position abzuschließen, was sich negativ auf seine Wertentwicklung auswirken könnte.

Die Verwaltungsgesellschaft wendet einen angemessenen Prozess für das Liquiditätsrisikomanagement an, der Transaktionen im Rahmen des effizienten Portfoliomanagements durch die Fonds berücksichtigt, um sicherzustellen, dass die einzelnen Fonds in der Lage sind, ihre angegebenen Rücknahmeverpflichtungen zu erfüllen. Es ist jedoch möglich, dass unter den oben beschriebenen Umständen ein Fonds nicht in der Lage ist, Vermögenswerte in ausreichender Menge zu realisieren, um alle Rücknahmeaufträge zu erfüllen, oder die Verwaltungsgesellschaft kann feststellen, dass die Erfüllung bestimmter oder aller solcher Rücknahmeaufträge nicht im besten Interesse der Gesamtheit der Anteilinhaber eines Fonds ist. Unter solchen Umständen kann die Verwaltungsgesellschaft beschließen, die Bestimmungen betreffend die eingeschränkte Bearbeitung von Rücknahmeanträgen anzuwenden, die im Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen – Rücknahmebeschränkungen“ beschrieben sind, oder den Handel des jeweiligen Fonds gemäß den Erläuterungen im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Vorübergehende Aussetzung des Handels“ auszusetzen.

ETF-Liquiditätsrisiko. Ein Rückgang der Liquidität der Anlagen eines Fonds kann sich vorübergehend auf die Liquidität des Fonds selbst auswirken. Infolgedessen wird der betreffende Fonds unter Umständen an Börsen weniger häufig gehandelt und kann stärkeren Kursschwankungen unterliegen. Das wiederum kann sich darauf auswirken, wie problemlos und zu welchem Preis ein Anleger Fondsanteile auf dem Primär- oder Sekundärmarkt kaufen oder verkaufen

kann.

Die von einem Fonds vorgenommenen Anlagen werden es ihm zwar voraussichtlich ermöglichen, Rücknahmeanträge zu erfüllen, doch unter außergewöhnlichen Umständen, wenn der Verkauf bestimmter Wertpapiere nicht möglich ist oder bestehende Anteilinhaber stark beeinträchtigen würde, kann der Verwaltungsrat des Fonds Beschränkungen des Volumens und/oder Zeitpunkts von Rücknahmen festlegen wie im Abschnitt „**Ermittlung des Nettoinventarwerts – Vorübergehende Aussetzung des Handels**“ beschrieben.

Managementrisiko. Jeder Teilfonds unterliegt einem Managementrisiko. Das Urteil des Anlageverwalters bei der Auswahl und Anwendung von Indexmodellen und der effektivsten Methode zur Minimierung des Tracking Error (d.h. dem Unterschied zwischen der Rendite des Fonds und des maßgeblichen Index) kann sich als falsch erweisen, und es gibt keine Garantie, dass die gewünschten Ergebnisse erzielt werden. Jeder Teilfonds ist in hohem Maße abhängig von den kontinuierlichen Dienstleistungen von Mitarbeitern des Anlageverwalters. Tod, Arbeitsunfähigkeit oder Ausscheiden solcher Personen aus dem Unternehmen können negative Auswirkungen auf die Wertentwicklung des betreffenden Teilfonds haben.

Risiko im Zusammenhang mit einer Marktstörung und geopolitische Risiken. Die Fonds unterliegen dem Risiko, dass geopolitische Ereignisse Wertpapiermärkte stören und sich weltweit nachteilig auf Volkswirtschaften und Märkte auswirken. Krieg, Terrorismus, die Ausbreitung von Infektionskrankheiten oder sonstige Probleme der öffentlichen Gesundheit und ähnliche geopolitische Ereignisse haben zu einer höheren kurzfristigen Marktvolatilität geführt und können dies in der Zukunft tun und langfristig die Volkswirtschaft in den USA und Volkswirtschaften und Märkte weltweit generell beeinträchtigen.

Ebenso können systemische Marktverzerrungen für starke Unruhen in Volkswirtschaften und auf Märkten sorgen. Diese Ereignisse sowie andere Veränderungen in den wirtschaftlichen und politischen Bedingungen im Aus- und Inland könnten ebenfalls nachteilige Folgen für einzelne Emittenten oder verwandte Gruppen von Emittenten, Wertpapiermärkte, Zinsen, Kreditratings, die Inflation, die Anlegerstimmung und andere Faktoren haben, die sich auf den Wert der Anlagen eines Fonds auswirken. Die andauernde Ungewissheit in Bezug auf die Stabilität des Euros und der EWU hat generell zu einer beträchtlichen Volatilität auf Devisen- und Finanzmärkten geführt. Sorgen um die Stabilität des Euros könnten sich auch generell auf vertragliche Vereinbarungen auswirken, die auf den Euro lauten oder anderweitig an diesen gekoppelt sind. Eine teilweise oder komplette Auflösung der EWU oder eine andauernde Ungewissheit in Bezug auf ihre Lage könnte beträchtliche nachteilige Auswirkungen auf Devisen- und Finanzmärkte und auf die Werte der Portfolioanlagen eines Fonds haben.

Der Ausbruch einer Atemwegserkrankung, die durch ein neuartiges Coronavirus (unter dem Namen COVID-19 bekannt) verursacht wird, das erstmals im Dezember 2019 in China entdeckt wurde, hat zu einer globalen Pandemie und zu größeren Störungen in Volkswirtschaften und an Märkte in aller Welt geführt. Die Finanzmärkte verzeichnen extreme Volatilität und hohe Verluste, und der Handel mit vielen Instrumenten ist gestört. Bei zahlreichen Instrumenten ist die Liquidität zeitweilig stark verringert. Gewisse Zinssätze sind ausgesprochen niedrig und in manchen

Fällen sind die Renditen negativ. Die Regierungen und Zentralbanken ergreifen außergewöhnliche und beispiellose Maßnahmen, um die lokalen Volkswirtschaften und die Weltwirtschaft sowie die Finanzmärkte zu stützen. Welche Effekte diese Maßnahmen haben und ob sie der Wirtschafts- und Marktstörung effektiv entgegenwirken, wird sich erst mit der Zeit klären. Ferner könnten der Ausbruch von COVID-19 und die ergriffenen Maßnahmen zur Minderung seiner Auswirkungen zu Störungen bei den Dienstleistungen führen, die für einen Fonds von seinen Dienstleistern erbracht werden.

Marktrisiko. Die Anlagen eines Teilfonds sind beeinflusst durch Veränderungen der allgemeinen wirtschaftlichen Bedingungen, normale Marktschwankungen und die inhärenten Risiken von Anlagen an internationalen Wertpapiermärkten, und es kann keine Garantie dafür geben, dass eine Wertsteigerung eintreten wird. Anlagemärkte können volatil sein, und Wertpapierpreise können sich aufgrund verschiedener Faktoren wesentlich ändern, unter anderem aufgrund von Wirtschaftswachstum oder Rezession, Veränderungen von Zinssätzen, der Beurteilung der Bonität des Emittenten durch den Markt und der allgemeinen Marktliquidität. Auch wenn sich die allgemeinen wirtschaftlichen Bedingungen nicht verändern, kann der Wert einer Anlage in einem Fonds sinken, wenn bestimmte Branchen, Sektoren oder Unternehmen, in die der Fonds investiert, sich schwach entwickeln oder von Ereignissen negativ beeinflusst sind. Bei Schuldtiteln ist das Ausmaß dieser Kursfluktuationen größer, je länger die Laufzeit der ausstehenden Wertpapiere währt. Da Anlagen in Wertpapieren mit anderen Währungen als der Basiswährung eines Fonds verbunden sein können, kann der Wert der Vermögenswerte eines Fonds auch von Wechselkursveränderungen und Änderungen der Devisenkontrollbestimmungen, einschließlich Devisensperren, beeinflusst sein. Ferner können gesetzliche, politische, aufsichtsrechtliche und steuerliche Veränderungen Schwankungen der Markt- und Wertpapierpreise verursachen.

Die Wertentwicklung eines Fonds hängt daher teilweise von der Fähigkeit des Anlageverwalters ab, auf diese Schwankungen in Aktienkursen, Marktzinsen und Wechselkursen zu reagieren und geeignete Strategien einzusetzen, um Ergebnisse zu maximieren und gleichzeitig zu versuchen, die mit dem Anlagekapital verbundenen Risiken zu mindern.

Risiko keiner bisherigen Geschäftstätigkeit. Jeder Fonds ist bei Auflegung ein neu gegründetes Unternehmen mit begrenzten Betriebshistorien, und es kann keine Garantie geben, dass er erfolgreich sein wird. Die Wertentwicklung der Vergangenheit ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse.

OTC-Clearing-Risiko. Bestimmte von einem Fonds eingegangene Derivatetransaktionen müssen zentral abgewickelt werden. Bei einer abgewickelten Derivatetransaktion ist der Kontrahent des Fonds für die Transaktion eher eine zentrale Clearing-Organisation oder ein zentrales Clearing-Haus für Derivate als eine Bank oder ein Händler. In der Regel wickelt der Fonds Derivatetransaktionen über Clearing-Teilnehmer ab, die Futures-Makler, sogenannte Futures Commission Merchants, und Teilnehmer der Clearing-Häuser sind. Der Fonds leistet und erhält Zahlungen, die ihm aus abgewickelten Derivatetransaktionen zustehen (Einschusszahlungen inbegriffen), über seine Konten bei Clearing-Teilnehmern. Die Clearing-Teilnehmer des Fonds

garantieren, dass der Fonds seine Verpflichtungen gegenüber dem Clearing-Haus erfüllt. Anders als bei bilateralen Derivatetransaktionen können Clearing-Teilnehmer generell jederzeit die Auflösung von bestehenden abgewickelten Derivatetransaktionen verlangen oder die Höhe der vom Fonds dem Clearing-Teilnehmer zu stellenden Einschusszahlung für neue oder bestehende abgewickelte Derivatetransaktionen über die vom Clearing-Haus oder dem Clearing-Mitglied verlangte Höhe anheben. Derartige Auflösungen oder Erhöhungen könnten für den Fonds zu Verlusten im Zusammenhang mit seinen abgewickelten Derivatepositionen führen. Ferner unterliegt der Fonds dem Ausführungsrisiko in Bezug auf abgewickelte Derivatetransaktionen, da es sein kann, dass kein Clearing-Teilnehmer zur Abwicklung einer bestimmten Transaktion für den Fonds bereit ist. In diesem Fall müsste die Transaktion aufgelöst werden, und der Fonds könnte den Vorteil von einer Wertsteigerung der Transaktion nach dem Handelszeitpunkt ganz oder teilweise verlieren. Darüber hinaus ist die Dokumentation, welche die Beziehung zwischen einem Fonds und einem Clearing-Mitglied regelt und von den Clearing-Mitgliedern formuliert wird, generell nicht verhandelbar und deshalb weniger günstig für den Fonds als typische bilaterale Derivatdokumente. Diese und andere neue Regeln und Bestimmungen könnten unter anderem die Fähigkeit eines Fonds beschränken, Derivatetransaktionen einzugehen, oder die diesbezüglichen Kosten für den Fonds erhöhen und somit den Einsatz von Derivaten durch den Fonds undurchführbar oder generell unerwünscht machen. Diese Bestimmungen sind neu und werden kontinuierlich weiterentwickelt, deshalb sind ihre potenziellen Auswirkungen auf die Fonds und das Finanzsystem noch nicht bekannt. Auch wenn die neuen Bestimmungen und das zentrale Clearing einiger Derivatetransaktionen das systemische Risiko senken sollen, gibt es keine Sicherheit, dass der neue Clearing-Mechanismus dieses Ergebnis erzielt, und unterdessen sind die Fonds durch das zentrale Clearing gemäß obiger Ausführung neuen Risiken und Kosten ausgesetzt.

EMIR und Risiken von OTC-Derivatekontrakten. Infolge der europäischen Verordnung, die allgemein als die Verordnung über die europäische Marktinfrastruktur oder „EMIR“ bekannt ist, wurden und werden die Märkte für OTC-Derivatekontrakte erheblichen Regulierungsaufgaben unterworfen, zu denen unter anderem erhöhte Einschusszahlungen, Meldepflichten und eine Zentralisierung des Clearing und der Ausführung von Transaktionen gehören. Diese Vorschriften können höhere Kosten, geringere Gewinnspannen und eingeschränkte Investitionsmöglichkeiten mit sich bringen und sich damit negativ auf die Wertentwicklung der Fonds auswirken.

EMIR stellt bestimmte Anforderungen zur Besicherung von Derivatetransaktionen, die nicht über eine Clearing-Haus abgewickelt oder an einer Börse gehandelt werden. Dazu gehörten auch Devisentermingeschäfte. Demnach kann der Austausch von Sicherheiten zwischen einem Fonds und den Kontrahenten des Geschäfts erforderlich sein, um das durch die tägliche Marktbewertung bedingte Risiko jeder Partei eines Devisentermingeschäfts abzudecken. Dadurch können Änderungen an den bestehenden OTC-Derivatekontrakten der Gesellschaft erforderlich werden, die zu zusätzlichen Kosten führen würden. Die Vorschriften zu den Nachschusszahlungen verlangen auch die Anwendung bestimmter Risikoabschlüsse auf Sicherheiten, die für OTC-Derivatekontrakte entgegengenommen wurden, die je nach Emittent, Bonität, Währung und Restlaufzeit der Sicherheiten variieren. Da die Vorschriften zu den

Nachschusszahlungen wahrscheinlich zu einem Anstieg des Vermögens führen werden, das ein Fonds in bar oder in sehr liquiden Vermögenswerten halten muss, damit es als Sicherheiten zur Verfügung steht, könnte der Vermögensanteil, der dem Fonds für seine Anlagepolitik zur Verfügung steht, sinken und damit der potenzielle Tracking Error für den Fonds steigen.

Einige der Vorschriften gemäß EMIR sind bereits in Kraft getreten, eine Reihe von Anforderungen befinden sich in Übergangsfristen. Infolgedessen ist noch unklar, wie sich die Märkte für Derivate an das neue Aufsichtssystem anpassen werden.

Somit ist es schwierig, die vollen Auswirkungen der EMIR auf die Gesellschaft zu prognostizieren, wozu allerdings steigende Gesamtkosten für den Abschluss und das Halten von OTC-Derivatekontrakten zählen können.

Risiko einer überdurchschnittlichen Entwicklung. Es gibt keine Garantie, dass das Anlageziel eines Fonds erreicht wird. Es gibt insbesondere kein Finanzinstrument, das es möglich machen würde, die Entwicklung eines Index zu reproduzieren oder genau nachzubilden, oder das garantieren würde, dass das Ziel einer überdurchschnittlichen Entwicklung erreicht wird. Veränderungen in den Anlagen eines Fonds und Neugewichtungen des maßgeblichen Index können diverse Transaktionskosten (unter anderem im Zusammenhang mit der Abrechnung von Devisentransaktionen), betriebliche Aufwendungen oder Ineffizienzen zur Folge haben, die das Ziel eines Fonds - eine bessere Wertentwicklung zu erzielen als der Index - beeinträchtigen können. Außerdem wird die Gesamtrendite einer Anlage in Aktien durch bestimmte Kosten und Auslagen, die bei der Berechnung des entsprechenden Index nicht berücksichtigt werden, reduziert. Bitte lesen Sie auch den vorstehenden Abschnitt „Indexnachbildungsrisiko“.

Häufige Transaktionen / Portfolioumschlagsrisiko. Der Portfolioumschlag ist in der Regel mit einer Reihe von direkten und indirekten Kosten und Aufwendungen für den betreffenden Fonds verbunden, unter anderem mit Maklerprovisionen, Händleraufschlägen und Geld/Brief-Spannen sowie mit Transaktionskosten beim Verkauf von Wertpapieren und der Wiederanlage in anderen Wertpapieren. Dennoch kann ein Fonds zur Förderung seines Anlageziels mit seinen Anlagen aktive und/oder häufige Transaktionen tätigen. Die Kosten eines erhöhten Portfolioumschlags reduzieren die Anlagerendite eines Teilfonds, und der Verkauf von Wertpapieren durch einen Teilfonds kann zur Realisierung steuerpflichtiger Veräußerungsgewinne, einschließlich kurzfristiger Kapitalerträge, führen.

Risiko im Zusammenhang mit vorläufiger Zuteilung. Da die Gesellschaft potenziellen Anlegern Anteile bereits vor Eingang der für diese Anteile erforderlichen Zeichnungsgelder zuteilen kann, kann die Gesellschaft infolge der Nichtzahlung solcher Zeichnungsgelder Verluste erleiden.

Risiken im Zusammenhang mit Immobilienfonds (Reits) und Immobilienwertpapieren. Real Estate Investment Trusts („REITs“) sind Trusts (Investmentgesellschaften), die in erster Linie in Gewerbeimmobilien investieren. Investiert ein Fonds in REITs, kann der Wert seiner Beteiligungen an REITs vom Wert der Immobilien im Besitz des Trusts beeinflusst werden. Die Liquidität von REITs an den großen internationalen Börsen ist durchschnittlich geringer als im

Fall einer typischen Aktie von internationalen Blue-Chip-Unternehmen, die an einem anerkannten Markt notiert, gelistet oder gehandelt wird. Bitte lesen Sie auch die obigen Risikohinweise unter der Überschrift „**Liquiditätsrisiko**“.

Die Anlage in Wertpapiere von Unternehmen, die sich in Immobilienmärkten betätigen, wie z.B. (aber ohne Einschränkungen) REITs und Bauträger im Immobiliensektor, ist mit besonderen Risiken verbunden. Eine Anlage in einem Immobilienunternehmen kann mit ähnlichen Risiken verbunden sein, die auch für den direkten Besitz von Immobilien gelten: Die Möglichkeit des Wertverlusts der Immobilie, Verluste aus Haftpflicht und Enteignung und Veränderungen der lokalen und allgemeinen Wirtschaftsbedingungen, Angebot und Nachfrage, Zinsen, Umwelthaftung, Bebauungspläne, gesetzliche Mietbegrenzungen, Grundsteuern und Betriebskosten. Des Weiteren unterliegt eine Anlage in ein Immobilienunternehmen zusätzlichen Risiken, wie die schwache Leistung des Managers des Immobilienunternehmens, nachteilige Änderungen im Steuerrecht und die Auswirkung eines generellen Rückgangs von Aktienkursen. Manche Immobilienunternehmen könnten nur begrenzt diversifiziert sein, da sie in eine begrenzte Anzahl von Immobilien, eine eingeschränkte geografische Region oder in nur einen Immobilientyp investieren. Die Gründungsdokumente eines Immobilienunternehmens können auch Bestimmungen enthalten, die Änderungen in der Kontrolle des Immobilienunternehmens schwierig und zeitaufwändig machen. Als Aktionär eines Immobilienunternehmens hätte der Fonds und indirekt die Anteilinhaber des Fonds seinen verhältnismäßigen Anteil an den Aufwendungen des Immobilienunternehmens zu tragen und gleichzeitig weiterhin seine eigenen Gebühren und Kosten zu zahlen. Diese Faktoren könnten sich nachteilig auf die Wertentwicklung des Fonds auswirken. Außer den mit Anlagen in Wertpapiere von Immobilienunternehmen verbundenen Risiken verfügen REITs über bestimmte zusätzliche Risiken. Equity REITs können von Wertveränderungen der im Besitz des REIT befindlichen Immobilie betroffen sein, während Mortgage REITs von der Qualität der gewährten Kredite beeinflusst sein können. Außerdem erfordern REITs spezialisierte Verwaltungskenntnisse. Ihre Investitionen können auf relativ wenige Objekte oder einen kleinen geografischen Bereich oder einen einzelnen Immobilientyp begrenzt sein. REITs sind sehr stark Cashflow-abhängig und anfällig für Ausfälle von Kreditnehmern und Selbstliquidierung. Diese Faktoren können sich auch nachteilig auf die Verpflichtungen eines Kreditnehmers oder eines Mieters gegenüber einem REIT auswirken, was wiederum die Erträge des Fonds beeinträchtigt. Bei Zahlungsausfall eines Kreditnehmers oder Mieters kann es für den REIT zu Verzögerungen bei der Durchsetzung seiner Rechte als Hypothekengläubiger bzw. Vermieter kommen, was erhebliche Kosten im Zusammenhang mit dem Schutz seiner Investitionen verursachen kann. Außerdem kann es sein, dass ein REIT unter Steuergesetzen Einkommen nicht steuerfrei weitergeben kann oder seine Befreiung von einer Registrierung unter dem US Investment Company Act von 1940 nicht aufrecht erhalten kann, was negative Folgen für einen Fonds hätte.

Aufsichtsrechtliches Risiko. Die Gesellschaft wird durch die Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften reguliert. Angesichts des aktuell ungewissen und veränderlichen aufsichtsrechtlichen Umfelds und geplanter Änderungen an den OGAW-Vorschriften und sonstiger künftiger

Verordnung, der die Gesellschaft unterliegen kann, kann nicht garantiert werden, dass die Gesellschaft weiter in der jetzigen Art und Weise tätig sein kann, und solche künftigen aufsichtsrechtlichen Veränderungen können sich nachteilig auf die Wertentwicklung der Fonds und/oder ihre Fähigkeit, ihre Anlageziele zu erfüllen, auswirken.

Risiko im Zusammenhang mit Pensions- und Umgekehrten Pensionsgeschäften. Der Teilfonds kann Pensionsgeschäfte abschließen, kraft deren er ein Wertpapier verkauft und vereinbart, dies zu einem einvernehmlich vereinbarten Termin und Preis zurückzukaufen. Pensionsgeschäfte sind mit dem Risiko verbunden, dass der Marktwert der von einem Fonds verkauften Wertpapiere unter den Preis fällt, zu dem dieser Fonds verpflichtet ist, diese Wertpapiere im Rahmen des Vertrags zurückzukaufen. Für den Fall, dass der Erwerber von Wertpapieren im Rahmen eines Pensionsgeschäfts einen Insolvenzantrag stellt oder sich als insolvent erweist, kann die Verwendung von Erlösen aus dem Pensionsgeschäft durch den Fonds eingeschränkt sein, solange die Entscheidung der anderen Vertragspartei oder ihres Treuhänders oder Insolvenzverwalters über die Durchsetzung der Verpflichtung zum Rückkauf der Wertpapiere aussteht.

Die Fonds können zudem umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen, wonach ein Fonds Wertpapiere von einem Verkäufer erwirbt (z. B. von einer Bank oder einem Wertpapierhändler), der zum Zeitpunkt des Verkaufs sich verpflichtet, die Wertpapiere zu einem einvernehmlich vereinbarten Termin (üblicherweise spätestens sieben Tage nach dem Kaufdatum) und Preis zurückzukaufen, sodass der Ertrag des betreffenden Teilfonds während der Laufzeit des Pensionsgeschäftes festgelegt ist. Versäumt der Verkäufer es bei einem Pensionsgeschäft, im Rahmen eines umgekehrten Pensionsgeschäfts seiner Verpflichtung zum Rückkauf eines Wertpapiers vereinbarungsgemäß nachzukommen, kann der Fonds einen Schaden erleiden. Dieser Schaden entspricht den Einkünften aus dem Verkauf der Wertpapiere abzüglich des Rückkaufpreises. Wird der Verkäufer zahlungsunfähig, kann ein Konkursgericht entscheiden, dass die Wertpapiere nicht dem betreffenden Fonds gehören, und anordnen, dass die Wertpapiere verkauft werden, um die Schulden des Verkäufers abzutragen. Für einen Fonds können sowohl Verzögerungen als auch Verluste bei der Realisierung der zugrunde liegenden Wertpapiere in dem Zeitraum entstehen, in dem er versucht, seine Rechte durchzusetzen, einschließlich möglicher subnormaler Erträge und dem fehlenden Zugang zu Erträgen in diesem Zeitraum sowie Kosten zur Durchsetzung seiner Rechte.

Risiko von Investitionen in andere gemeinsame Anlagen.

Investiert ein Fonds in andere gemeinsame Anlagen oder Anlagemöglichkeiten, ist er dem Risiko ausgesetzt, dass diese anderen Anlagemöglichkeiten sich nicht erwartungsgemäß entwickeln. Der Fonds ist indirekt allen Risiken ausgesetzt, denen eine Anlage in einer solchen anderen Anlagemöglichkeit unterliegt. Außerdem könnte mangelnde Liquidität bei der zugrunde liegenden Anlageform dazu führen, dass sein Wert eine höhere Volatilität aufweist, als das zugrunde liegende Wertpapierportfolio. Außerdem könnte die Fähigkeit des Fonds eingeschränkt werden seinen Anteil an der Anlagemöglichkeit zu einem Zeitpunkt oder einem Preis, den er für attraktiv hält, zu verkaufen. Vorbehaltlich der Einschränkung in Absatz 3.1 des Abschnitts

„Anlagebeschränkungen“ können sich die Anlagepolitik und die Einschränkungen der jeweils anderen Anlagemöglichkeit von denen des Fonds unterscheiden. Der Fonds kann daher aufgrund seiner Investition in eine andere Anlagemöglichkeit zusätzlichen oder anderen Risiken ausgesetzt sein oder eine geringere Rendite erzielen. Ein Fonds trägt auch seinen proportionalen Anteil an den Kosten einer Anlagemöglichkeit, in die er investiert. Bitte lesen Sie in Hinsicht auf möglicherweise bestehende Interessenkonflikte, die sich aus Investitionen in andere gemeinsame Anlagen oder Anlagemöglichkeiten ergeben können, auch die vorstehenden Risikohinweise unter der Überschrift „Interessenkonflikte“. Investiert ein Fonds auf eine Weise in eine andere gemeinsame Anlage oder Anlagemöglichkeit, dass er zu einem Feederfonds in Hinsicht auf den jeweils anderen Fonds wird (der über eine im Wesentlichen ähnliche Anlagepolitik und Beschränkungen wie der jeweilige Fonds verfügt), steigen die Risiken, die mit einem der vorstehend beschriebenen Anlagen verbunden sind, entsprechend. Ein Fonds unterliegt keiner vorübergehenden oder anfänglichen Gebühr oder Rücknahmegebühr in Hinsicht auf Investitionen, die in anderen Fonds der Gesellschaft oder in einem anderen Investmentfonds, dessen Verwalter ein verbundenes Unternehmen ist, getätigt werden. Außerdem müssen alle Provisionen, die ein Anlageverwalter aufgrund der Investition eines Fonds in eine andere gemeinsame Anlage oder einen anderen Fonds der Gesellschaft erhält, zu den Vermögenswerten des investierenden Fonds hinzugefügt werden. Der Anlageverwalter darf, sofern er aus dem Vermögen eines Fonds vergütet wird, keine Anlageverwaltungsgebühren in Hinsicht auf den Teil des Vermögens des Fonds berechnen, der in andere Fonds der Gesellschaft investiert sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in Russland.

Auch wenn Anlagen in russischen Wertpapieren voraussichtlich keinen wesentlichen Anteil an den Anlagen der Fonds haben werden (sofern im maßgeblichen Nachtrag nichts anderes offengelegt ist), sollten Anleger beachten, dass Anlagen in Russland mit erheblichen Risiken verbunden sind. Diese Risiken beinhalten:

- Verzögerungen bei der Abrechnung von Transaktionen und das Verlustrisiko, das sich aus dem russischen System der Registrierung und Verwahrung von Wertpapieren ergibt;
- mangelnde Bestimmungen zur Unternehmensführung (Corporate Governance), unterentwickelte oder nicht existente Regelungen bezüglich der Pflichten der Unternehmensleitung gegenüber den Aktionären und ein Mangel an allgemeinen Regeln oder Bestimmungen zu Anlegerschutz bzw. Anlagen;
- weit verbreitete Korruption, Insider-Handel und Kriminalität im russischen Wirtschaftssystem;
- Schwierigkeiten bei der Beschaffung genauer Marktbewertungen für viele russische Wertpapiere, die teilweise durch begrenzten öffentlichen Zugang zu Informationen bedingt sind;
- das Risiko der Erhebung willkürlicher oder belastender Steuern aufgrund von mehrdeutigen und unklaren Steuergesetzen;
- die allgemeine finanzielle Lage russischer Unternehmen, die besonders hohe konzerninterne Verbindlichkeiten mit sich bringen kann;

- Banken und andere Finanzsysteme sind nicht gut entwickelt oder reguliert und infolgedessen nicht ausreichend getestet und haben niedrige Kreditratings;
- fehlende lokale Gesetze und Bestimmungen, die es einer Unternehmensführung verbieten bzw. nur eingeschränkt erlauben, die Unternehmensstruktur ohne Zustimmung der Aktionäre wesentlich zu verändern;
- Schwierigkeiten, im Falle von Verstößen gegen lokale Gesetze, Bestimmungen oder Verträge oder der willkürlichen und uneinheitlichen Anwendung von Gesetzen und Bestimmungen durch Gerichte auf gerichtlichem Wege Abhilfe zu schaffen; und
- das Risiko, dass die russische Regierung oder andere Organe der Exekutive oder Legislative beschließen, die wirtschaftlichen Reformprogramme, die seit der Auflösung der Sowjetunion eingeführt wurden, nicht weiter zu unterstützen.

Wertpapiere in Russland werden nur in Form eines Bucheintrags ausgegeben, und Eigentümerverzeichnisse werden bei Registerstellen geführt, die unter Vertrag mit den Emittenten stehen. Die Registerstellen sind weder Vertreter der Verwahrstelle oder ihrer lokalen Vertreter in Russland, noch gegenüber diesen rechenschaftspflichtig. Übertragungsempfänger von Wertpapieren haben in Bezug auf Wertpapiere erst dann Eigentumsrechte, wenn ihr Name im Register der Inhaber der Wertpapiere des Emittenten erscheint. Die Gesetze und die Praxis in Bezug auf die Registrierung von Inhabern von Wertpapieren sind in Russland nicht gut entwickelt, und es können Verzögerungen bei Registrierungen eintreten oder Registrierungen nicht stattfinden. Obwohl russische Unterdepotbanken in ihren Geschäftsräumen Kopien der Aufzeichnungen der Registerstelle („Auszüge“) aufbewahren, stellen diese Auszüge möglicherweise keinen ausreichenden rechtsgültigen Nachweis für das Eigentum an Wertpapieren dar. Außerdem sind auf den russischen Märkten eine Reihe von gefälschten oder anderweitig betrügerischen Wertpapieren, Auszügen und sonstigen Dokumenten im Umlauf, weshalb das Risiko besteht, dass die Käufe des Fonds mit solchen gefälschten oder betrügerischen Wertpapieren abgewickelt werden. Ebenso wie andere Schwellenmärkte hat Russland keine zentrale Quelle für die Herausgabe oder Veröffentlichung von Informationen über Kapitalmaßnahmen von Unternehmen. Die Verwahrstelle kann daher nicht die Vollständigkeit oder Pünktlichkeit der Verbreitung von Mitteilungen über Kapitalmaßnahmen garantieren.

Anlagen in Wertpapieren, die in Russland notiert sind oder gehandelt werden, werden nur in Wertpapieren getätigt, die an der MICEX oder RTS notiert sind oder gehandelt werden.

Risiken im Zusammenhang mit den Sanktionen gegen Russland

Gegen Russland sowie juristische und natürliche russische Personen gerichtete Sanktionen, die von einer Reihe von Ländern, darunter die Vereinigten Staaten, die EU-Länder und das Vereinigte Königreich, angedroht oder verhängt wurden, sowie weitere zwischenstaatliche Maßnahmen, die bereits ergriffen wurden oder möglicherweise künftig ergriffen werden, können zu einer Abwertung der russischen Währung, einer Herabstufung der Bonität des Landes, dem unverzüglichen Einfrieren russischer Vermögenswerte,

einem Rückgang des Werts und der Liquidität russischer Wertpapiere, Immobilien oder Beteiligungen und/oder weiteren nachteiligen Folgen für die russische Wirtschaft oder einen Fonds führen. Umfang und Tragweite der jeweils verhängten Sanktionen können so ausgeweitet oder anderweitig modifiziert werden, dass es sich negativ auf einen Fonds auswirkt. Sanktionen oder die Androhung neuer oder modifizierter Sanktionen könnten die Fähigkeit eines Fonds beeinträchtigen, bestimmte betroffene Wertpapiere oder sonstige Anlageinstrumente zu erwerben, zu veräußern, zu halten, entgegenzunehmen, zu liefern oder sonstige Transaktionen damit durchzuführen. Sanktionen könnten auch zur Folge haben, dass Russland daraufhin Gegen- oder andere Maßnahmen ergreift, die den Wert und die Liquidität russischer Wertpapiere zusätzlich beeinträchtigen. Diese Sanktionen und die resultierenden Störungen der russischen Wirtschaft können auf anderen regionalen und globalen Märkten Volatilität auslösen und sich negativ auf die Wertentwicklung verschiedener Sektoren und Branchen, aber auch auf Unternehmen in anderen Ländern auswirken, was negative Effekte auf die Wertentwicklung eines Fonds haben könnte, auch wenn ein Fonds gar nicht direkt in Wertpapieren russischer Emittenten engagiert ist. Als Gesamtfolge der verhängten Sanktionen, der Gegenmaßnahmen der russischen Regierung und der Auswirkungen, die diese bisher auf die Handelsmärkte für russische Wertpapiere haben, haben bestimmte Fonds Verfahren zur Zeitwertbewertung eingesetzt (und könnten diese künftig einsetzen), die von der Verwaltungsgesellschaft für die Bewertung bestimmter russischer Wertpapiere genehmigt wurden. Dies könnte dazu führen, dass solche Wertpapiere zu einem Wert von null angesetzt werden.

Verringert sich die Liquidität bestimmter Fondspositionen infolge von Sanktionen und damit verbundenen Maßnahmen, kann das zu höheren Auf- oder Abschlägen auf den Nettoinventarwert eines Fonds und/oder zu größeren Geld/Brief-Spannen führen. Ferner gilt: Wird es für einen Fonds praktisch undurchführbar oder ungesetzlich, Wertpapiere zu halten, die Sanktionen unterliegen oder anderweitig davon betroffen sind, oder wird es vom Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter des Fonds als angemessen erachtet, so kann der Fonds im Zusammenhang mit Zeichnungsanträgen Zeichnungen der betreffenden Wertpapiere gegen Sachwerte untersagen und stattdessen Zeichnungen gegen Barzahlung verlangen, wodurch sich auch die Transaktionskosten des Fonds erhöhen können.

Risiken im Zusammenhang mit Screenings: Bestimmte Fonds verwenden einen Filter (entweder im Rahmen eines Index oder durch Anwendung außerhalb eines Index), der sich auf Kriterien stützt, die bestimmte nachhaltigkeitsbezogene oder andere Merkmale eines Unternehmens oder eines anderen Wertpapieremittenten (im Sinne dieser Offenlegung jeweils ein „**Emittent**“) beinhalten können. Der Filter kann ganz oder teilweise vom Anbieter des Benchmarkindex, vom Anlageverwalter, von einer Konzerngesellschaft des Anlageverwalters oder von einer anderen Partei (jeweils als „**Filteranbieter**“ bezeichnet) konzipiert und/oder umgesetzt werden. Eine Beurteilung von Filterkriterien durch einen Filteranbieter basiert auf von Dritten bereitgestellten Daten. Derartige Daten können unvollständig, unrichtig oder nicht verfügbar sein, was zu einer falschen Beurteilung der Nachhaltigkeit oder anderer Merkmale des Emittenten führen könnte. Für bestimmte Märkte und Emittenten- oder Wertpapiergattungen (insbesondere bestimmte von Staaten

oder Unternehmen begebene festverzinsliche Wertpapiere) können erhebliche Einschränkungen der Menge verfügbarer Filterdaten vorliegen oder gar keine Filterdaten verfügbar sein, sodass kein Filterprozess stattfindet. In bestimmten Situationen, in denen keine Filterdaten für einen Emittenten zur Verfügung stehen, kann der Filteranbieter stellvertretend Daten zu einem anderen Rechtsträger als dem Emittenten heranziehen, was mit dem Risiko verbunden ist, dass diese Daten die Nachhaltigkeit oder andere Merkmale des Emittenten nicht genau widerspiegeln. In bestimmten Situationen kann es vorkommen, dass Filterdaten zwar verfügbar sind, aber im Rahmen des Filterprozesses des Filteranbieters nicht eingesetzt werden können. Die für einen Fonds eingesetzten Filter sind unter Umständen für den beabsichtigten Zweck nicht geeignet, was dazu führen könnte, dass Emittenten im Anlageentscheidungsprozess für den Fonds zu Unrecht berücksichtigt oder ausgeschlossen werden. Es besteht ein Risiko, dass beim Screening-Verfahren Fehler gemacht werden können. Es kann insbesondere zu Fehlentscheidungen kommen wie die Aufnahme falscher/der Ausschluss richtiger Komponenten, die Fehlinterpretation von Emittentenmerkmalen, Transkriptionsfehler und eine falsche Beurteilung und Anwendung der jeweiligen Filterkriterien. Des Weiteren besteht ein Risiko, dass der Filteranbieter seine Filterdienste oder seinen Filterprozess verändern oder einstellen kann und dass sich die vom Filteranbieter herangezogenen Datenquellen verändern oder eingestellt werden. Unter diesen Umständen könnte es dazu kommen, dass Emittenten in dem für den Fonds verwendeten Anlageentscheidungsprozess zu Unrecht berücksichtigt oder ausgeschlossen werden. Generell findet der Filterprozess auf Emittentenebene statt, nicht auf der Ebene der von dem Emittenten emittierten Wertpapiere. Dementsprechend besteht ein Risiko, dass die Nachhaltigkeit oder andere Merkmale des Emittenten eines von dem Fonds gehaltenen Wertpapiers von den Merkmalen des Wertpapiers abweichen. Die vorstehenden mit Filterprozessen, Filteranbietern und Datenquellen verbundenen Risiken können dazu führen, dass ein Fonds Wertpapiere hält, die er eigentlich nicht halten sollte, oder Wertpapiere ausschließt, die er eigentlich in sein Portfolio aufnehmen sollte, und die Fähigkeit des Fonds, sein Anlageziel zu erreichen, kann eingeschränkt werden.

Risiko der Wertpapierleihe. Tätigt ein Fonds Wertpapierleihgeschäfte, so besteht das Risiko, dass der Entleiher insolvent wird oder anderweitig seine Verpflichtungen zur Rückgabe von den verliehenen Wertpapieren gleichwertigen Wertpapieren nicht erfüllen kann oder will. In diesem Fall können dem Fonds Verzögerungen bei der Beitreibung der Wertpapiere und ein Kapitalverlust entstehen. Beim Verleih von Wertpapieren des Portfolios besteht das Risiko, dass Wertpapiere dem Fonds nicht zeitnah zur Verfügung stehen. Der Fonds kann daher möglicherweise eine Gelegenheit verpassen, die Wertpapiere zu einem attraktiven Preis zu veräußern.

Ein Fonds kann, wenn ein Kontrahent ausfällt und keine den verliehenen Wertpapieren gleichwertigen Wertpapiere liefert, einen Verlust erleiden, der der Differenz zwischen dem Wert der verwerteten Sicherheit und dem Marktwert der Ersatzsicherheiten entspricht. Soweit Wertpapierleihgeschäfte nicht in vollem Umfang abgesichert sind (zum Beispiel aufgrund von Zeitverzögerungen bei der Verbuchung von Sicherheiten), ist der Fonds gegenüber dem Kontrahenten in einem Wertpapierleihgeschäft einem Kreditrisiko ausgesetzt. Anleger sollten auch die Risikohinweise unter der Überschrift „**Kontrahentenrisiko**“

im Abschnitt „**Risikoinformationen**“ lesen. Der Fonds kann auch Geld verlieren, wenn der Wert der Sicherheit fällt. Diese Ereignisse können nachteilige steuerliche Konsequenzen für den Fonds haben.

Erfüllungsrisiko. Märkte in unterschiedlichen Ländern verfügen auch über unterschiedliche Clearing- und Abrechnungsverfahren. In manchen Märkten gibt es Zeiten, zu denen Abrechnungen nicht mit dem Transaktionsvolumen Schritt halten können. Dadurch ist es schwierig, solche Transaktionen durchzuführen. Verzögerungen bei den Abrechnungen können zu vorübergehenden Phasen führen, während denen das Vermögen des Fonds nicht investiert ist und daher keine Erträge mit ihm erzielt werden. Die Unfähigkeit eines Fonds, beabsichtigte Käufe aufgrund von Abrechnungsproblemen durchzuführen, könnte dazu führen, dass attraktive Anlagemöglichkeiten verpasst werden, und dass die Fähigkeit zur Nachbildung des entsprechenden Index beeinträchtigt wird. Die Unfähigkeit, Portfoliowertpapiere aufgrund von Abrechnungsproblemen zu veräußern, kann entweder zu Verlusten eines Fonds aufgrund anschließender Kursverluste des Portfoliowertpapiers führen oder, falls der Fonds einen Vertrag über den Verkauf des Wertpapiers abgeschlossen hat, zu einer potenziellen Haftung gegenüber dem Käufer.

Werden freigegebene Geldmittel für eine Zeichnung nicht fristgerecht erhalten, können Überziehungszinsen anfallen. Es kann zu Verlusten bei der Veräußerung von Fondswertpapieren aufgrund von Kursverlusten kommen, wenn der Anlageverwalter im Vertrauen auf den Eingang von Zeichnungsgeldern, die dann aber nicht gezahlt werden, einen Vertrag über den Kauf von Wertpapieren abschließt.

In bestimmten Ländern kann die Abwicklungszeit für Wertpapiere, in die der Fonds investiert, kürzer sein als die für Zeichnungen und Rücknahmen geltende Abrechnungszeit, wenn ein Anleger in den Fonds investiert oder Anteile am Fonds zurückgibt. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter können bzw. kann mit dem Handelskontrahenten eine Verlängerung der Abrechnungszeit für Wertpapiere mit einer kürzeren Abrechnungszeit als der Fonds zur Anpassung an den Zeichnungs- und Rücknahmezyklus des Fonds vereinbaren. Dies kann zu höheren Maklergebühren führen, die zu voraussichtlichen Abgaben und Gebühren hinzugerechnet werden können. Wenn die Abrechnungszeit für Wertpapiere, die vom Fonds im Zusammenhang mit einer Zeichnung gekauft werden, nicht verlängert wird, kann dies dazu führen, dass der Fonds sein Konto überzieht oder Gelder von einem Kreditgeber leihen muss, was beides zu zusätzlichen Kosten führen kann. Des Weiteren können dem Fonds Gebühren im Zusammenhang mit einer bestehenden Kreditfazilität, die dem Fonds in solchen Situationen die Aufnahme von Geldern ermöglicht, entstehen. Jegliche Kosten im Zusammenhang mit der Kreditfazilität werden dem Fonds belastet. Ferner können bzw. kann der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter alternative Portfoliomanagement-Tools verwenden, wie etwa börsengehandelte Futures (soweit zulässig), oder einen höheren Liquiditätspuffer wahren, um die ungleiche Ausrichtung zwischen der Abwicklungszeit zugrunde liegender Wertpapiere und dem Zeichnungs- und Rücknahmezyklus des Fonds zu managen.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko. SFDR ist eine EU-Verordnung, die eine größere Transparenz in Bezug auf den Nachhaltigkeitsgrad von Finanzprodukten sowie die Vereinheitlichung von nachhaltigkeitsbezogenen

Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor anstrebt. In der ersten Phase ihrer Umsetzung müssen Informationen in Bezug auf den Ansatz eines Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters bei der Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken in Anlageentscheidungen in den Prospekt aufgenommen werden. Im Rahmen dieser Anfangsphase müssen die Fonds auch gemäß den von der SFDR festgelegten Kriterien klassifiziert werden. Das heißt, (i) ob Nachhaltigkeitsrisiken in die für einen Fonds getätigten Anlageentscheidungen einbezogen werden oder nicht (Artikel 6 der SFDR) und (ii)(a) ob ein Fonds ökologische und/oder soziale Merkmale fördert (Artikel 8 der SFDR) oder (ii)(b) ob ein Fonds eine nachhaltige Anlage zu seinem Ziel hat (Artikel 9 der SFDR).

Zum Datum dieses Prospekts wurden die umzusetzenden aufsichtsrechtlichen technischen Standards (Stufe 2) für die SFDR verabschiedet, aber einige von der SFDR eingeführten Konzepte sind derzeit nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Die Fonds wurden in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Prospekt und auf der Website angegebenen Informationen und Klassifizierungen im Zusammenhang mit der SFDR Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilklassen. Da es keine Haftungstrennung zwischen den Anteilklassen des Fonds gibt, besteht das Risiko, das unter bestimmten, eingeschränkten Bedingungen, die Verbindlichkeiten einer bestimmten Klasse sich möglicherweise auf den Nettoinventarwert anderer Klassen auswirken. Obwohl der Anlageverwalter bestrebt sein wird sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie zum Vorteil einer bestimmten Anteilsklasse eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden und nicht mit denen einer anderen Anteilsklasse des Fonds kombiniert oder verrechnet werden, kann nicht garantiert werden, dass der Anlageverwalter dabei erfolgreich sein wird.

Zeichnungs- und Rücknahmesammelkonto. Zeichnungsgelder, die vor Ausgabe der Anteile für einen Fonds erhalten werden, werden im Namen der Gesellschaft in dem Umbrella-Barsammelkonto gehalten. Anleger sind in Hinblick auf den gezeichneten Betrag ungesicherte Gläubiger solch eines Fonds bis die Anteile ausgegeben werden und profitieren nicht von Zugewinnen des Nettoinventarwerts des Fonds oder von jedweden Rechten von Anteilsinhabern (einschließlich Dividendenansprüche) bis die Anteile ausgegeben wurden. Im Fall einer Insolvenz des Fonds oder der Gesellschaft besteht keine Garantie, dass der Fonds oder die Gesellschaft über ausreichende Mittel verfügt, um ungesicherte Gläubiger vollständig auszuzahlen.

Die Zahlung von Rücknahmeerlösen und Dividenden durch den Fonds erfolgt vorbehaltlich des Eingangs der ursprünglichen Zeichnungsdokumente beim Verwalter und der Einhaltung aller Verfahren zur Vermeidung von Geldwäsche. Ungeachtet dessen sind einlösende Anteilinhaber in Hinblick auf die zurückgegebenen Anteile ab dem jeweiligen Rückgabetermin keine Anteilinhaber mehr. Einlösende Anteilinhaber und Anteilinhaber mit Anspruch auf Ausschüttungen sind, wie zutreffend, ab dem Rücknahme- bzw. Ausschüttungstermin, ungesicherte Gläubiger des jeweiligen Fonds und profitieren nicht mehr

von Zugewinnen des Nettoinventarwerts des Fonds oder von jedweden anderen Rechten von Anteilhabern (einschließlich weiterer Ausschüttungsansprüche) in Hinblick auf den Rücknahme- oder Ausschüttungsbetrag. Im Fall einer Insolvenz des Fonds oder der Gesellschaft während dieses Zeitraums besteht keine Garantie, dass der Fonds oder die Gesellschaft über ausreichende Mittel verfügt, um ungesicherte Gläubiger vollständig auszuzahlen. Einlösende Anteilhaber und Anteilhaber mit Anspruch auf Ausschüttungen sollten daher sicherstellen, dass alle ausstehenden Dokumente und Informationen dem Verwalter zeitnah bereitgestellt werden. Ein Versäumnis dies zu tun geht auf das eigene Risiko des Anteilhabers.

Im Fall der Insolvenz eines anderen Fonds der Gesellschaft erfolgt die Beitreibung von Beträgen, auf die ein Fonds Anspruch hat, die aber in Folge der Unterhaltung des Umbrella-Barsammelkontos an den anderen Fonds übertragen wurden, vorbehaltlich der Grundsätze des irischen Trust-Rechts und den Bedingungen der Betriebsverfahren für das Umbrella-Barsammelkonto. Es können bei der Umsetzung und / oder bei Streitigkeiten im Zusammenhang mit der Beitreibung solcher Beträge Verzögerungen auftreten und es kann sein, dass der insolvente Fonds nicht über ausreichende Mittel zur Rückzahlung der dem jeweiligen Fonds geschuldeten Beträge verfügt. Demnach besteht keine Garantie, dass der Fonds oder die Gesellschaft solche Beträge wiedererlangen wird. Weiterhin besteht keine Garantie, dass der Fonds oder die Gesellschaft unter solchen Umständen über ausreichende Mittel zur Zurückzahlung ungesicherter Gläubiger verfügt.

Rücknahmen in großem Umfang. Vorbehaltlich und unbeschadet der Befugnisse des Verwaltungsrats, Rücknahmen auszusetzen und/oder den Nettoinventarwert der Anteile eines Fonds, die an einem Handelstag zurückgenommen werden können, zu begrenzen, können umfangreiche Rücknahmeanträge von Anteilhabern in einem konzentrierten Zeitraum es erforderlich machen, dass ein Fonds bestimmte Anlagen schneller liquidiert, als es wünschenswert wäre, um Liquidität für die Finanzierung der Rücknahme zu erzielen und ein Portfolio zu erreichen, dass eine geringere Vermögensbasis angemessen widerspiegelt. Dies kann die Fähigkeit des Anlageverwalters einschränken, das Anlageprogramm eines Fonds erfolgreich umzusetzen, und es kann sich negativ auf den Wert der zurückgenommenen Anteile und den Wert der noch umlaufenden Anteile auswirken. Darüber hinaus kann ein Fonds nach Erhalt eines Rücknahmeantrags gezwungen sein, Vermögenswerte vor dem betreffenden Handelstag zu liquidieren, was dazu führen kann, dass ein Fonds vor diesem Handelstag Barmittel oder hoch liquide Anlagen hält. In einer solchen Phase kann die Fähigkeit des Anlageverwalters, das Anlageprogramm eines Fonds umzusetzen, eingeschränkt sein, und die Renditen des Fonds können dadurch geschmälert werden.

Ferner kann unabhängig von dem Zeitraum, über den umfangreiche Rücknahmeanträge gestellt werden, die daraus resultierende Reduzierung des Nettoinventarwerts eines Fonds es dem Fonds erschweren, Gewinne zu erzielen oder Verluste wieder einzubringen. Die Anteilhaber erhalten von einem Fonds keine Mitteilung über umfangreiche Rücknahmeanträge für einen bestimmten Handelstag, sodass sie gegebenenfalls nicht die Möglichkeit haben, ihre Anteile oder Teile davon vor oder gleichzeitig mit den zurückgebenden Anteilhabern

zurückzugeben.

Nachhaltigkeitsrisiko. Ein Fonds gibt in seinem maßgeblichen Nachtrag an, ob er Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht oder nicht. Ein Nachhaltigkeitsrisiko ist von der SFDR als ein ökologisches, soziales oder Unternehmensführungsereignis oder ein Zustand bezeichnet, das bzw. der beim Eintreten tatsächlich oder potenziell wesentliche negative Auswirkungen auf den Wert der Anlage haben könnte. Die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken in den Anlageprozess des Fonds gewährleistet nicht die Minderung eines oder aller Nachhaltigkeitsrisiken, und das Ausmaß, in dem die Steuerung von Nachhaltigkeitsrisiken in die Verwaltung der Vermögenswerte eines Fonds einbezogen werden kann oder wird, hängt von den Merkmalen des Fonds ab.

Ein nachhaltigkeitsbezogenes Risikoereignis kann den Marktkurs oder die Liquidität einer zugrunde liegenden Anlage wesentlich beeinträchtigen. Diese Veränderung im Profil der zugrunde liegenden Anlage kann erst im Zeitverlauf offensichtlich werden, und zum Zeitpunkt, an dem sie im Portfolio des Fonds realisiert wird, kann die Veränderung im Wert oder in der Liquidität plötzlich und/oder wesentlich sein. Anlageentscheidungen, die Nachhaltigkeitsrisiken einbeziehen, können Annahmen beinhalten, wie diese Risiken in der Zukunft eintreten können. Diese Annahmen können falsch oder unvollständig sein, und das Nachhaltigkeitsrisiko kann gar nicht oder nicht so wie erwartet eintreten. Eine Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben.

Die Wertentwicklung von Fonds, die Nachhaltigkeitsrisiken nicht in ihren Anlageprozess einbeziehen, kann durch eintretende nachhaltigkeitsbezogene Risikoereignisse negativer beeinflusst werden als bei Fonds, wo dies der Fall ist.

Steuerrisiko. Die im Abschnitt „Steuerinformationen“ enthaltenen Informationen basieren auf der besten Kenntnis des Verwaltungsrates von den Steuergesetzen und -praktiken bei Herausgabe dieses Prospekts und stehen unter dem Vorbehalt von Änderungen. Jede Änderung in der Steuergesetzgebung in Irland oder einer anderen Rechtsordnung, in dem ein Fonds registriert ist, notiert, vermarktet wird oder anlegt, könnte sich auf den Steuerstatus der Gesellschaft und der einzelnen Fonds, auf den Wert der Anlagen des betreffenden Fonds in der betreffenden Rechtsordnung und auf die Fähigkeit des betreffenden Fonds, sein Anlageziel zu erreichen, auswirken und/oder die Nachsteuerrendite der Anteilhaber verändern. Wenn ein Fonds in Derivatekontrakte anlegt, können diese Erwägungen auch auf die Rechtsordnung angewandt werden, in denen das Recht des Derivatekontrakts und/oder des betreffenden Kontrahenten und/oder der Märkte gilt, in denen der Derivatekontrakt engagiert ist. Die Möglichkeit der Inanspruchnahme und die Höhe der Anlegern zur Verfügung stehenden Steuervergünstigungen hängen von den persönlichen Umständen jedes Anteilhabers ab. Die Informationen im Abschnitt „Steuerinformationen“ sind nicht erschöpfend und stellen keine Rechts- oder Steuerberatung dar. Zukünftige Anteilhaber sollten sich in Bezug auf ihre individuelle Steuersituation und die steuerlichen Auswirkungen einer Anlage in den Fonds an ihre Steuerberater wenden. Wenn ein Fonds in einer Rechtsordnung investiert, in der das Steuersystem nicht vollständig entwickelt oder nicht

ausreichend sicher ist, sind die Gesellschaft, der jeweilige Fonds, der Anlageverwalter, die Verwahrstelle und der Administrator nicht verpflichtet, den Anteilhabern gegenüber Rechenschaft über Zahlungen für Steuern oder andere Abgaben der Gesellschaft oder des jeweiligen Fonds abzulegen, die von der Gesellschaft oder dem jeweiligen Fonds in gutem Glauben an eine Steuerbehörde geleistet werden bzw. von einer solchen ihr gegenüber erhoben wurden, auch wenn sich später herausstellt, dass diese Zahlungen nicht hätten geleistet werden müssen bzw. ihr gegenüber nicht hätten erhoben werden dürfen.

Die Gesellschaft kann in anderen Ländern als Irland Steuern (einschließlich Quellensteuern) auf aus ihren Anlagen erzielten Erträgen und Veräußerungsgewinnen unterliegen. Die Gesellschaft ist möglicherweise aufgrund bestehender Doppelbesteuerungsabkommen zwischen Irland und anderen Staaten nicht in der Lage, von einer Senkung im Satz dieser ausländischen Steuer zu profitieren. Deshalb kann die Gesellschaft möglicherweise von ihr in bestimmten Ländern abgeführte ausländische Quellensteuern nicht zurückfordern. Wenn sich diese Situation in Zukunft ändert und die Gesellschaft eine Rückzahlung ausländischer Steuern erhält, wird der Nettoinventarwert eines Fonds nicht neu festgesetzt, sondern die Rückzahlung auf die zum Zeitpunkt der Rückzahlung bestehenden Anteilhaber anteilig umgelegt.

Indische und brasilianische Kapitalertragsteuer werden auf indische und brasilianische Wertpapiere angewandt. Kapitalertragsteuern, die aufgrund von Portfoliotransaktionen im Zusammenhang mit Rücknahmen kalkulierbar sind, werden gemäß der Definition von „Abgaben und Gebühren“ behandelt und können zu einem zusätzlichen Spread führen, der den für die Rücknahme erhaltenen Nettoerlös reduzieren kann. Kapitalertragsteuern, die durch sich nicht auf Rücknahmen beziehende Portfoliotransaktionen (z. B. Neugewichtung) angefallen sind, werden vom jeweiligen Fonds getragen.

Anleger sollten sich darüber im Klaren sein, dass die Wertentwicklung von Fonds gegenüber einem Index in Fällen, wenn die vom jeweiligen Indexanbieter in dessen Indexberechnungsmethode gemachten steuerlichen Annahmen von der tatsächlichen steuerlichen Behandlung der von Fonds gehaltenen Basiswertpapiere des Index abweichen, nachteilig beeinträchtigt werden kann.

Risiken im Zusammenhang mit der Besteuerung in der VRC. Der Handel im Rahmen von QFI-Regime und SHHK und SZHK Stock Connect ist derzeit befristet von der Einkommensteuer und der Mehrwertsteuer der VRC auf Gewinne aus der Übertragung von chinesischen A-Aktien befreit. Es ist ungewiss, wann diese Ausnahmen auslaufen und ob andere Steuern in der VRC auf den Handel mit chinesischen A-Aktien im Rahmen von QFI-Regime und SHHK und SZHK Stock Connect erhoben werden. Dividenden, die aus chinesischen A-Aktien erzielt werden, unterliegen der Quellensteuer der VRC. Die Stempelgebühr der VRC ist für Geschäfte mit chinesischen A-Aktien ebenfalls zahlbar. Es gibt jedoch keine Garantie, wie lange die Ausnahme andauern wird, und es gibt keine Gewissheit, dass der Handel mit chinesischen A-Aktien nicht in Zukunft einer solchen Steuer unterliegen wird. Die Steuerbehörden des chinesischen Festlands können künftig diesbezüglich weitere Richtlinien erlassen, möglicherweise auch rückwirkend.

Derzeit gibt es keine spezifischen Leitlinien der chinesischen Steuerbehörden für die steuerliche Behandlung von

Einkommen aus Handelsgewinnen und andere Steuerkategorien, die im Zusammenhang mit dem Handel am CIBM von ausländischen Anlegern zu zahlen sind. Bevor weitere Leitlinien herausgegeben werden und in der Verwaltungspraxis der chinesischen Steuerbehörden gut verankert sind, können die Praktiken der chinesischen Steuerbehörden, die Steuern der VRC in Bezug auf die CIBM-Transaktionen erheben, von den hierin beschriebenen Praktiken in Bezug auf vergleichbare Anlagen oder von weiteren Leitlinien abweichen oder in einer mit diesen unvereinbaren Weise angewendet werden. Der Wert einer Fondsanlage in der VRC und die daraus erzielten Erträge und Gewinne könnten durch einen Anstieg der Steuersätze oder eine Änderung der Besteuerungsgrundlage beeinträchtigt werden.

Bezüglich Bond Connect ist die steuerliche Behandlung von Handelsgewinnen gemäß den (nachstehend definierten) geltenden Bond-Connect-Gesetzen und -Regelungen nicht ganz eindeutig. Dementsprechend gilt: Schreiben die geltenden Bond-Connect-Gesetze und -Regelungen vor, dass eine Depotbank/Clearingstelle/andere Stelle gemäß diesen Regelungen Steuern einziehen muss, oder hat eine solche Depotbank/Clearingstelle/andere Stelle Grund zu der Annahme, dass ein solcher Einbehalt erforderlich sein könnte, kann die Depotbank/Clearingstelle/andere Stelle diese Steuer zum vorschriftsmäßigen Satz einbehalten oder, wenn die (nachstehend definierten) geltenden Bond-Connect-Gesetze und -Regelungen diesen Satz nicht eindeutig festlegen, zu einem Satz, den die Depotbank/die Clearingstelle/sonstige Stelle nach vernünftigem Ermessen als angemessen feststellt. Steuern können auch rückwirkend einbehalten werden.

Angeichts der Unsicherheiten, wie Gewinne oder Erträge, die aus den Anlagen des Fonds in der VRC erzielt werden, besteuert werden, behält sich die Gesellschaft das Recht vor, für Rechnung des Fonds Rückstellungen für Quellensteuern auf solche Gewinne oder Erträge und Quellensteuern zu bilden. Quellensteuern können bereits auf Makler-/Verwahrungsebene einbehalten werden. Etwaige Steuerrückstellungen werden im Rechnungsabschluss des Fonds zum Zeitpunkt der Bildung bzw. Auflösung der Rückstellung ausgewiesen.

Wenn die tatsächliche von den Steuerbehörden der VRC erhobene Steuer höher ist als die für den betreffenden Fonds gebildete Rückstellung, sodass bei der Steuerrückstellung ein Fehlbetrag vorliegt, müssen Anleger beachten, dass der Nettoinventarwert des Fonds in einem über die Steuerrückstellung hinausgehenden Umfang geschmälert werden kann, weil der Fonds letztlich die zusätzlichen Steuerverbindlichkeiten begleichen muss. In diesem Fall entsteht den zu diesem Zeitpunkt bestehenden Anlegern sowie neuen Anlegern ein Nachteil.

Wenn andererseits die tatsächliche von den Steuerbehörden der VRC erhobene Steuer geringer ist als die vom betreffenden Fonds gebildeten Rückstellungen, sodass eine überschüssige Rückstellung vorhanden ist, entsteht Anlegern, die Anteile vor einem entsprechenden Urteil bzw. einer entsprechenden Entscheidung oder Weisung der Steuerbehörden der VRC zurückgegeben haben, ein Nachteil, weil sie den Verlust aus der zu hohen Rückstellung getragen hätten. In diesem Fall können die zum betreffenden Zeitpunkt bestehenden Anleger profitieren, wenn die Differenz zwischen der Steuerrückstellung und der tatsächlichen Steuerverbindlichkeit wieder als Vermögenswerte in den betreffenden Fonds zurückfließen kann.

Ferner sollten sich Anleger darüber im Klaren sein, dass eine zu niedrige oder zu hohe Rückstellung für Steuerverbindlichkeiten in der VRC sich in der Phase einer solchen zu niedrigen oder zu hohen Rückstellung und nach entsprechenden Anpassungen des Nettoinventarwerts auf die Performance eines Fonds auswirken kann.

Im Falle einer überschüssigen Steuerrückstellung (z. B. weil die von den Steuerbehörden in der VRC tatsächlich erhobenen Steuern geringer sind als die Steuerrückstellung oder weil die Rückstellung eines Fonds geändert wurde) wird dieser Überschuss als Eigentum des betreffenden Fonds behandelt, und Anleger, die ihre Anteile des betreffenden Fonds bereits übertragen oder zurückgegeben haben, haben keinen Anspruch auf irgendeinen Teil des Betrages, der diesen Überschuss repräsentiert.

Risiko von Handelsproblemen. Obwohl die ETF-Anteile eines Fonds zum Handel an der/den maßgeblichen Wertpapierbörse(n) notiert werden, kann es keine Garantie geben, dass sich für diese ETF-Anteile ein aktiver Handelsmarkt entwickelt oder ein solcher fortbesteht. Der Handel mit ETF-Anteilen an einer Wertpapierbörse kann aufgrund von Marktbedingungen oder weil nach Ermessen der maßgeblichen Wertpapierbörse ein Handel mit den ETF-Anteilen nicht empfehlenswert ist, ausgesetzt werden. Darüber hinaus kann der Handel mit ETF-Anteilen der einzelnen Fonds an einer Wertpapierbörse auch bedingt durch eine ungewöhnlich hohe Volatilität nach den so genannten „Circuit Breaker“-Regelungen der Börse ausgesetzt werden. Es kann keine Garantie dafür geben, dass die Anforderungen einer Wertpapierbörse für die weitere Zulassung eines Fonds weiterhin erfüllt werden oder dass diese Anforderungen unverändert bleiben oder dass die ETF-Anteile in irgendeinem Volumen bzw. überhaupt an einer Börse gehandelt werden. Ferner können Wertpapiere, die an Börsen notiert sind und gehandelt werden, auch von Mitgliedern bzw. an Mitglieder dieser Börsen untereinander und von Dritten bzw. an Dritte zu Bedingungen und Preisen gekauft und verkauft werden, die auf Freiverkehrsbasis vereinbart werden, und können auch über andere multilaterale Handelssysteme oder -plattformen gekauft oder verkauft werden. Die Gesellschaft hat keine Kontrolle über die Bedingungen, zu denen solche Transaktionen stattfinden.

Auf dem Sekundärmarkt erworbene Anteile können in der Regel nicht direkt an die Gesellschaft zurückverkauft werden. Anleger müssen ETF-Anteile auf einem Sekundärmarkt mit der Unterstützung eines Intermediärs (z. B. ein Makler) kaufen bzw. verkaufen, und dabei können ihnen Gebühren entstehen. Ferner zahlen Anleger beim Kauf von ETF-Anteilen möglicherweise mehr als den aktuellen Nettoinventarwert je Anteil und erhalten weniger als den aktuellen Nettoinventarwert je Anteil beim Verkauf derselben.

Auf dem Sekundärmarkt erworbene ETF-Anteile können in der Regel nicht direkt an die Gesellschaft zurückverkauft werden. Unter außerordentlichen Umständen, ob infolge von Störungen auf dem Sekundärmarkt oder anderweitig, sind Anleger, die auf dem Sekundärmarkt ETF-Anteile erworben haben, berechtigt, bei der Gesellschaft schriftlich einen Antrag zu stellen, um die betreffenden ETF-Anteile in ihrem eigenen Namen registrieren zu lassen, um Zugang zu den im obigen Abschnitt „Primärmarkt“ beschriebenen Rücknahmemöglichkeiten zu erhalten. Anleger sollten für nähere Einzelheiten den Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen“ lesen.

Bewertungsrisiko. Die Anlagen eines Fonds werden in der Regel gemäß der Satzung und den geltenden Gesetzen zum jeweiligen Marktwert bewertet. Unter bestimmten Umständen kann ein Teil des Fondsvermögens durch die Verwaltungsgesellschaft zum beizulegenden Zeitwert unter Anwendung von Preisen bewertet werden, die von einem Pricing-Dienst oder alternativ von einem Makler/Händler oder einem anderen Marktmittler (gelegentlich auch nur ein einziger Makler/Händler oder anderer Marktmittler) gestellt werden, wenn keine anderen verlässlichen Bewertungsquellen verfügbar sind. Wenn aus diesen Quellen keine relevanten Informationen verfügbar sind oder die Verwaltungsgesellschaft die verfügbaren Informationen für unzuverlässig hält, kann die Verwaltungsgesellschaft die Vermögenswerte eines Fonds auf Basis anderer Informationen bewerten, die die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem eigenen Ermessen für angemessen erachtet. Es kann keine Garantie geben, dass diese Bewertungen genau den Preis widerspiegeln, den ein Fonds beim Verkauf eines Wertpapiers erhalten würde, und wenn ein Fonds ein Wertpapier zu einem niedrigeren Preis als dem Preis verkauft, der bei der Bewertung des Wertpapiers angesetzt wurde, beeinträchtigt dies den Nettoinventarwert des Fonds. Wenn ein Fonds in andere Fonds oder Anlage-Pools investiert, bewertet die Verwaltungsgesellschaft in der Regel seine Anlagen in einen Fonds oder Pools auf Basis der von den Fonds oder Pools ermittelten Bewertungen, die möglicherweise nicht den Bewertungen entsprechen, die sich ergeben hätten, wenn das Nettovermögen der Fonds oder Pools nach den von der Verwaltungsgesellschaft zur Bewertung der Vermögenswerte eines Fonds angewandten Verfahren bewertet worden wäre.

Volatilitätsrisiko. Anleger sollten beachten, dass die Volatilität eines Fonds im Laufe der Zeit schwanken kann und dass es keine Garantie geben kann, dass die Volatilitätsniveaus, die der Index in der Vergangenheit aufgewiesen hat, auch in Zukunft eingehalten werden können. Insoweit wie der Anlageverwalter DFI einsetzt, kann für einen Fonds das Risiko einer erhöhten Volatilität bestehen.

Risiken im Zusammenhang mit Aktienanlagen

Aktienrisiko. Aktienwerte stellen Eigentumsanteile an einem Unternehmen oder einer Kapitalgesellschaft dar und umfassen Stammaktien, Vorzugsaktien und Optionsscheine sowie andere Bezugsrechte zum Erwerb dieser Instrumente.

Anlagen in Aktienwerten unterliegen allgemein mehreren Faktoren, die dazu führen können, dass ihre Marktkurse im Laufe der Zeit schwanken, manchmal schnell oder unvorhergesehen. Der Wert von Aktienwerten kann aufgrund mehrerer Gründe fallen, die direkt mit dem Emittenten zusammenhängen können (siehe obigen Abschnitt „Emittentenrisiko“) oder aufgrund von allgemeinen Marktbedingungen, die nicht mit einem bestimmten Unternehmen oder Emittenten zusammenhängen, wie z. B. tatsächlichen oder wahrgenommenen widrigen Marktbedingungen, Veränderungen im allgemeinen Ausblick für Unternehmensgewinne, Zins- oder Wechselkursänderungen oder einer allgemein negativen Anlegerstimmung. Außerdem bewegen sich Aktienmärkte zyklisch. Das kann dazu führen, dass Aktienkurse über kürzere oder längere Zeiträume fallen. Ein Fonds kann auch unter allgemeinen Marktbedingungen, die der Anlageverwalter als ungünstig für Aktienwerte betrachtet, weiterhin neue Zeichnungen entgegennehmen und zusätzliche Anlagen in Aktienwerten tätigen.

Wenn ein Fonds in Aktienoptionsscheine investiert, sollten die Anteilinhaber sich bewusst sein, dass das Halten von Optionsscheinen zu einer erhöhten Volatilität des Nettoinventarwerts je Anteil des betreffenden Fonds führen kann. Bei Fonds, die in wandelbare Aktienwerte investieren, sollten sich Anteilinhaber auch bewusst sein, dass der Wert dieser Wertpapiere durch geltende Zinssätze, die Bonität des Emittenten und Rückkaufsklauseln beeinträchtigt werden kann. Bei indexnachbildenden Fonds würden Schwankungen im Wert der in einem Index enthaltenen Aktienwerte, dessen Wertentwicklung vom betreffenden Fonds nachgebildet wird, zu Schwankungen im Nettoinventarwert des betreffenden Fonds führen.

Risiko im Zusammenhang mit dem Anlagestil:

Aktienwerte fallen in der Regel unter vier Hauptkategorien – Unternehmen mit hoher, mittlerer, geringer und sehr geringer Marktkapitalisierung (Large Caps, Mid Caps, Small Caps und Micro Caps). Investiert ein Fonds überwiegend in eine dieser Kategorien, besteht das Risiko, dass aufgrund der aktuellen Marktbedingungen der Fonds eine schlechtere Wertentwicklung erzielt als ein Fonds, der in einer anderen Kategorie oder in mehreren Kategorien investiert ist. Die allgemeinen mit diesen Kategorien verbundenen Risiken sind nachstehend aufgeführt:

Large-Cap-Risiko – die Anlagerenditen aus Aktien großer Unternehmen können niedriger sein als die Renditen aus Anlagen in Aktien kleinerer und mittelgroßer Unternehmen.

Mid-Cap-Risiko – mittelgroße Unternehmen können volatiler sein und haben mit größerer Wahrscheinlichkeit als Unternehmen mit hoher Marktkapitalisierung relativ begrenzte Produktlinien, Märkte oder finanzielle Ressourcen oder sind von wenigen Schlüsselmitarbeitern abhängig. Die Anlagerenditen aus Aktien mittelgroßer Unternehmen können niedriger sein als die Renditen aus Anlagen in Aktien größerer und kleinerer Unternehmen.

Small-Cap-Risiko – kleine Unternehmen können volatiler sein und haben mit größerer Wahrscheinlichkeit als Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung relativ begrenzte Produktlinien, Märkte oder finanzielle Ressourcen oder sind von wenigen Schlüsselmitarbeitern abhängig. Die Anlagerenditen aus Aktien kleiner Unternehmen können niedriger sein als die Renditen aus Anlagen in Aktien größerer Unternehmen. Siehe auch „**Risiken im Zusammenhang mit kleinen Unternehmen**“.

Micro-Cap-Risiko – sehr kleine Unternehmen können neu gegründet sein oder sich in den Frühphasen ihrer Entwicklung befinden und begrenzte Produktlinien, Märkte oder finanzielle Ressourcen haben. Daher sind sehr kleine Unternehmen möglicherweise finanziell weniger sicher als Unternehmen mit hoher, mittlerer und geringer Marktkapitalisierung und daher anfälliger beim Ausscheiden wichtiger Mitarbeiter, weil sie von einer kleineren Anzahl von Führungskräften abhängig sind. Darüber hinaus sind über solche Unternehmen möglicherweise weniger öffentliche Informationen verfügbar. Die Aktienkurse von Unternehmen mit sehr geringer Marktkapitalisierung können volatiler sein als die Kurse von Unternehmen mit hoher, mittlerer und geringer Marktkapitalisierung, und solche Aktien haben möglicherweise ein geringeres Handelsvolumen und sind daher gegebenenfalls für einen Fonds auf dem Markt schwer zu kaufen und zu verkaufen. Siehe auch „**Risiken im Zusammenhang mit kleinen Unternehmen**“.

Risiken im Zusammenhang mit kleinen Unternehmen. Kleine Unternehmen bieten möglicherweise größere

Kapitalwachstumschancen als größere Unternehmen, sind aber in der Regel auch anfälliger für negative Entwicklungen als größere Unternehmen, und Anlagen in diesen Unternehmen können mit bestimmten besonderen Risiken verbunden sein. Kleine Unternehmen haben möglicherweise begrenzte Produktlinien, Märkte oder finanzielle Ressourcen und können von einer begrenzten Gruppe von Führungspersonen abhängig sein. Hinzu kommt, dass diese Unternehmen möglicherweise neu gegründet sind und nur eine kurze oder gar keine Erfolgshistorie aufweisen. Es ist auch möglich, dass der Anlageverwalter keine Gelegenheit hatte, die Wertentwicklung solcher neuen Unternehmen unter widrigen oder schwankenden Marktbedingungen zu evaluieren. Die Wertpapiere kleiner Unternehmen werden möglicherweise weniger häufig und in geringeren Volumen gehandelt als Wertpapiere mit breiter Inhaberschaft. Die Preise dieser Wertpapiere können stärker schwanken als die Preise anderer Wertpapiere, und ein Fonds kann möglicherweise Schwierigkeiten haben, Positionen in diesen Wertpapieren zu den geltenden Marktpreisen aufzubauen oder zu veräußern. Es sind möglicherweise weniger öffentliche Informationen über die Emittenten dieser Wertpapiere verfügbar, oder es herrscht ein geringeres Marktinteresse an diesen Wertpapieren als im Falle von größeren Unternehmen. Beides kann eine erhebliche Marktvolatilität mit sich bringen. Manche Wertpapiere kleinerer Emittenten können illiquide sein oder Weiterverkaufsbeschränkungen unterliegen.

Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in Schuldtiteln

Risiken im Zusammenhang mit Schuldtiteln - Festverzinsliche Wertpapiere und andere Ertrag erzielende Wertpapiere stellen Verpflichtungen ihrer Emittenten dar, zu späteren Zeitpunkten Kapital- und/oder Zinszahlungen zu leisten. Wenn die Zinsen steigen, fällt in der Regel der Wert von Schuldtiteln und anderen verzinslichen Anlagen. Dieses Risiko ist in der Regel bei Schuldtiteln mit längeren Laufzeiten höher. Schuldtitel und andere Ertrag erzielende Wertpapiere sind zudem mit dem Risiko behaftet, dass der Emittent oder der Bürge eines Wertpapiers nicht in der Lage oder nicht bereit ist, Kapital- und/oder Zinszahlungen pünktlich zu leisten oder anderweitig seine Verpflichtungen zu erfüllen. Dieses Risiko ist bei Schuldtiteln mit niedriger Bonität und hohen Renditen besonders ausgeprägt.

Weitere allgemeine Risiken, denen Schuldtitel unterliegen können, sind:

Kreditrisiko – die Fähigkeit oder angenommene Fähigkeit des Emittenten eines Schuldtitels, Zins- und Kapitalzahlungen auf den Schuldtitel pünktlich zu leisten, hat Einfluss auf den Wert des Wertpapiers. Es ist möglich, dass sich die Fähigkeit eines Emittenten, seine Verpflichtungen zu erfüllen, in dem Zeitraum, in dem ein Teilfonds Wertpapiere dieses Emittenten hält, erheblich verschlechtert oder dass der Emittent seine Verpflichtungen nicht erfüllt. Siehe auch „**Emittentenrisiko**“. Eine tatsächliche oder angenommene Verschlechterung der Fähigkeit eines Emittenten, seine Verpflichtungen zu erfüllen, wirkt sich mit hoher Wahrscheinlichkeit negativ auf den Wert der Wertpapiere des Emittenten aus. Mit bestimmten Ausnahmen ist das Kreditrisiko in der Regel bei Anlagen, die unter ihrem Nennwert ausgegeben werden und deren Zinszahlungen bei Fälligkeit statt in regelmäßigen Abständen während der Dauer der Anlage vorgesehen sind, höher. Ratingagenturen vergeben ihre Ratings zu einem Großteil auf Basis der finanziellen Lage des Emittenten in der Vergangenheit und auf Basis der Anlageanalyse der Ratingagenturen zum Zeitpunkt des Ratings. Das Rating,

das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Obwohl Wertpapiere mit Investment Grade in der Regel ein niedrigeres Kreditrisiko haben als Wertpapiere mit Ratings unter Investment Grade, können auch sie einige der Risiken von Anlagen mit niedrigeren Ratings aufweisen, unter anderem die Möglichkeit, dass die Emittenten nicht in der Lage sind, Zins- und Kapitalzahlungen pünktlich zu leisten, und damit ein Ausfall eintritt. Dementsprechend kann es keine Garantie geben, dass Wertpapiere mit Investment Grade keinen Kreditschwierigkeiten unterliegen können, die zum Verlust eines Teils oder des gesamten in solche Wertpapiere investierten Betrages führen können. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters dennoch weiter halten.

Verlängerungsrisiko – in Phasen steigender Zinsen kann sich die Durchschnittslaufzeit bestimmter Arten von Wertpapieren aufgrund von unerwartet langsamen Kapitalzahlungen verlängern. Dadurch kann ein Zinssatz unterhalb des Marktzins festgeschrieben und die Duration des Wertpapiers erhöht werden und somit der Wert des Wertpapiers sinken. Das Verlängerungsrisiko kann sich in Phasen allgemein widriger Wirtschaftsbedingungen erhöhen, da aufgrund steigender Arbeitslosigkeit und anderer Faktoren die Tilgungsraten sinken.

Ertragsrisiko – insoweit wie der Ertrag eines Fonds auf kurzfristigen Zinsen basiert, die über kurze Zeiträume schwanken können, kann der Ertrag des Fonds infolge von Zinsrückgängen sinken.

Zinsänderungsrisiko – der Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln steigt und fällt in der Regel in Reaktion auf die Veränderung von Zinssätzen. Sinkende Zinsen erhöhen generell den Wert bestehender Schuldtitel, und steigende Zinsen reduzieren generell den Wert bestehender Schuldtitel. Das Zinsänderungsrisiko ist generell bei Anlagen mit längerer Duration oder längeren Laufzeiten höher und kann auch bei bestimmten Typen von Schuldtiteln, wie z. B. Nullkuponanleihen und Anleihen mit aufgeschobener Zinszahlung höher sein. Das Zinsänderungsrisiko ist ebenfalls relevant in Situationen, in denen ein Emittent eine Anlage vor Fälligkeit kündigt oder tilgt. Siehe auch den nachstehenden Abschnitt „Risiko der vorzeitigen Rückzahlung“. Variabel verzinsliche Instrumente reagieren in der Regel in ähnlicher Weise auf Zinsveränderungen, wenn auch im Allgemeinen in geringerem Maße (dies ist jedoch abhängig von den Reset-Bedingungen, insbesondere vom gewählten Index, der Häufigkeit des Reset und von Ober- bzw. Untergrenzen für den Reset).

Risiken im Zusammenhang mit Wertpapieren niedrigerer Bonität – Wertpapiere mit Ratings unter Investment Grade (d. h. Hochzinsanleihen oder Junk Bonds) weisen typischerweise keine herausragenden Anlagequalitäten auf und sind spekulativer Natur und unterliegen höheren Kredit- und Marktrisiken als Wertpapiere mit höheren Ratings. Die niedrigeren Ratings von Junk Bonds spiegeln eine höhere Wahrscheinlichkeit wider, dass negative Veränderungen in der finanziellen Lage des Emittenten oder der allgemeinen Wirtschaftslage oder ein unerwarteter Zinsanstieg die Fähigkeit des Emittenten beeinträchtigt, Zins- und Kapitalzahlungen zu leisten. Tritt dies ein, kann der Wert solcher in einem Fonds gehaltenen Wertpapiere volatiler werden, und der Fonds kann einen

Total- oder Teilverlust seiner Anlagen erleiden.

Risiko der vorzeitigen Rückzahlung – ein Schuldtitel, der von einem Fonds gehalten wird, könnte vor Fälligkeit zurückgezahlt oder „gekündigt“ werden, und der Fonds kann gezwungen sein, den Erlös der Rückzahlung zu niedrigeren Zinsen zu reinvestieren, wodurch er von Wertsteigerungen infolge sinkender Zinsen nicht mehr profitiert. Mittelfristige und langfristige Anleihen bieten hier im Allgemeinen Schutz, nicht jedoch hypothekenbesicherte Wertpapiere (MBS-Anleihen). MBS-Anleihen sind anfälliger für das Risiko vorzeitiger Rückzahlungen, weil sie jederzeit vorzeitig zurückgezahlt werden können, wenn die zugrunde liegende Sicherheit vorzeitig zurückgezahlt wird.

Risiken im Zusammenhang mit MBS- und ABS-Anleihen. Hypothekenbezogene Wertpapiere ermöglichen ein Engagement in Hypothekendarlehen oder werden durch diese besichert. Andere durch Forderungen unterlegte Wertpapiere sind üblicherweise wie Forderungen aus Hypothekendarlehen unterlegte Wertpapiere strukturiert. Statt Hypothekendarlehen oder einer Beteiligung an einem Hypothekendarlehen können die zugrunde liegenden Werte Positionen wie Ratenzahlungen für Kraftfahrzeuge oder Ratenkreditverträge, Miet- bzw. Leasingverträge für Immobilien oder persönliches Eigentum und Forderungen aus Kreditkartenverträgen umfassen. Während Phasen fallender Zinsen können hypothekenbezogene und andere durch Forderungen unterlegte Wertpapiere, die dem Kreditnehmer normalerweise das Recht verleihen, den Kreditbetrag bereits vor Fälligkeit zu tilgen, vorzeitig getilgt werden. Das kann dazu führen, dass ein Fonds die Erlöse anderweitig zu niedrigeren Zinsen neu investieren muss. In Phasen steigender Zinsen kann sich die durchschnittliche Laufzeit hypothekenbezogener und anderer durch Forderungen unterlegter Wertpapiere aufgrund langsamer als erwarteter Tilgungszahlungen verlangsamen. Dadurch kann ein Zinssatz unterhalb des Marktzins festgeschrieben und die Duration und Volatilität des Wertpapiers erhöht werden und somit der Wert des Wertpapiers sinken. Hypothekenbezogene und andere durch Forderungen unterlegte Wertpapiere können daher während Phasen sinkender Zinsen über weniger Potenzial zum Wertgewinn verfügen als andere Wertpapiere mit vergleichbaren Laufzeiten. Allerdings können sie während Phasen steigender Zinsen ein ähnliches Risiko des Marktwertverlusts aufweisen. Tilgungsquoten lassen sich nur schwer vorhersagen. Die potenziellen Auswirkungen von Tilgungszahlungen auf den Wert eines hypothekenbezogenen oder anderen durch Forderungen unterlegten Wertpapiers hängt von den Bedingungen des Instruments ab. Dies kann zu einer erheblichen Volatilität führen. Der Kurs von hypothekenbezogenen oder anderen durch Forderungen unterlegten Wertpapieren hängt außerdem von der Kreditqualität und Hinlänglichkeit der zugrunde liegenden Vermögenswerte bzw. Sicherheitsleistungen, sofern es überhaupt welche gibt, ab. Ausfälle bei den zugrunde liegenden Vermögenswerten, sofern es welche gibt, können den Wert eines hypothekenbezogenen oder anderweitig durch Forderungen unterlegten Wertpapiers beeinträchtigen. Bei einigen durch Forderungen unterlegten Wertpapieren, in die ein Fonds investiert, zum Beispiele jene, die durch Kreditkartenforderungen unterlegt sind, werden die zugrunde liegenden Cashflows möglicherweise nicht durch Sicherungsinteressen in mit ihnen verbundenen Vermögenswerten unterstützt. Außerdem können die Werte von hypothekenbezogenen oder anderen durch Forderungen unterlegten Wertpapieren in hohem Maße von

der Verwaltung des zugrunde liegenden Pools von Vermögenswerten abhängen und unterliegt daher Risiken, die mit Fahrlässigkeit oder fehlerhafter Ausführung durch deren Verwalter und dem Kreditrisiko dieser Verwalter zusammenhängen. In bestimmten Situationen kann auch der fehlerhafte Umgang mit der zugehörigen Dokumentation Auswirkungen auf die Rechte von Wertpapierinhabern in Bezug auf eine ggf. vorhandene zugrunde liegende Sicherheit haben. Außerdem können juristische und praktische Beschränkungen in Hinsicht auf die Durchsetzbarkeit von Sicherungsinteressen, die im Zusammenhang mit zugrunde liegenden Vermögenswerten oder den Wert der zugrunde liegenden Vermögenswerte gewährt wurden, dazu führen, dass ihr Wert im Fall eines Zahlungsausfalls des Kreditnehmers unzureichend ist. In einer sogenannten „Forward-Roll“-Transaktion verkauft ein Fonds ein hypothekenbezogenes Wertpapier an eine Bank oder eine andere Einrichtung und verpflichtet sich gleichzeitig zu einem späteren Zeitpunkt ein ähnliches Wertpapier zu einem vereinbarten Preis zu erwerben. Die hypothekenbezogenen Wertpapiere, die erworben werden, tragen die gleichen Zinsen wie die veräußerten. Sie werden aber im Allgemeinen über verschiedene Hypothekepakete mit anderen Tilgungsverläufen als die der verkauften besichert. Die Risiken dieser „Rolls“ von hypothekenbezogenen Wertpapieren sind: Das Risiko einer Tilgung vor Fälligkeit und das Risiko, dass der Marktwert der Wertpapiere, die von einem Fonds veräußert werden, unter den Kurs sinken, den der Fonds für die Wertpapiere bezahlen muss. „Forward-Roll“ Transaktionen können einen Investitionshebel in einem Fonds schaffen.

Risiken im Zusammenhang mit Staatsanleihen. Ein Fonds kann in Schuldtitel von Regierungen oder deren Behörden und Stellen sowie von staatlich geförderten Unternehmen investieren. Der Wert dieser Wertpapiere kann von der Bonität der jeweiligen Regierung beeinflusst sein, unter anderem auch durch einen Ausfall oder möglichen Ausfall der jeweiligen Regierung. Darüber hinaus ist es möglich, dass die Zahlungsverpflichtungen des Emittenten im Hinblick auf Wertpapiere, die von Behörden, staatlichen Stellen und staatlich geförderten Unternehmen ausgegeben werden, keine oder nur begrenzte Unterstützung der jeweiligen Regierung erfahren.

Variabel verzinsliche Wertpapiere. Neben den herkömmlichen festverzinslichen Wertpapieren kann ein Fonds auch in Schuldtitel mit variabler Verzinsung oder Dividendenzahlungen investieren. Variabel verzinsliche Wertpapiere werden zu Sätzen verzinst, die regelmäßig nach einer Formel angepasst werden, die den Marktzins widerspiegeln soll. Diese Wertpapiere geben dem Fonds die Möglichkeit, an steigenden Zinsen durch entsprechende Anpassung des Kupons dieser Wertpapiere zu partizipieren. Allerdings können in Phasen steigender Zinsen die Anpassungen der Kupons mit einer Zeitverzögerung gegenüber den Marktzinsen erfolgen oder eine Obergrenze für die Anpassung der Kupons vorgesehen sein. Alternativ werden in Phasen sinkender Zinsen die Kupons solcher Wertpapiere nach unten angepasst, was zu einer niedrigeren Rendite führen kann.

Risiken im Zusammenhang mit Anlagen über Zugangsprogramme.

Risiken im Zusammenhang mit der Tagesquote von Stock Connect. SHHK Stock Connect und SZHK Stock Connect unterliegen jeweils einer Tagesquote. Die Tagesquote bildet eine Obergrenze für den täglichen Nettokaufwert grenzüberschreitender

Handelsgeschäfte über den jeweiligen Stock Connect. Die SEHK überwacht die Nutzung der Tagesquote im Nordwärtshandel („Northbound-Tagesquote“) in Bezug auf SHHK Stock Connect und SZHK Stock Connect und veröffentlicht auf der Website der HKEx das Restvolumen der Northbound-Tagesquote. Die SEHK kann Wertpapiere als China-Connect-Wertpapiere (wie in den Börsenregeln der SEHK definiert) aufnehmen oder ausschließen und die Qualifikation von Aktien für den Northbound-Handel über SHHK und SZHK Stock Connect ändern. Fällt das Restvolumen der Tagesquote für den Northbound-Handel auf null oder wird die Tagesquote während der Eröffnungsauktionssitzung überschritten, so werden neue Kaufaufträge über den jeweiligen Stock Connect zurückgewiesen (wobei allerdings Anleger ihre grenzüberschreitenden Wertpapiere unabhängig vom Restvolumen verkaufen dürfen), und es werden während der durchgehenden Auktionssitzung (oder der Schlussauktionssitzung) für die SZSE für den Rest des Tages keine weiteren Kaufaufträge mehr angenommen. Die Quotenbeschränkungen können die Möglichkeiten eines Fonds einschränken, zeitnah über Stock Connect in China-Connect-Wertpapiere zu investieren. Die Tagesquote kann sich ohne Vorankündigung jederzeit ändern, und Anleger sollten aktuelle Informationen auf der SEHK-Website und sonstige von der SEHK herausgegebene Informationen beachten.

Risiko im Zusammenhang mit der Aussetzung von Stock Connect. Es ist vorgesehen, dass die SEHK, SSE und SZSE sich das Recht vorbehalten, den Northbound-Handel (für Anlagen in Aktien der VRC) und/oder den Southbound-Handel (für Anlagen in Aktien in Hongkong) aussetzen, wenn dies notwendig ist, um einen geordneten und fairen Markt zu gewährleisten. Ferner ist vorgesehen, dass Risiken sorgfältig gesteuert werden. Bei einer Aussetzung des Northbound-Handels über Stock Connect können die Möglichkeiten des Fonds, Zugang zum Markt der VRC zu erhalten, beeinträchtigt sein. Wertpapiere (einschließlich China-Connect-Wertpapiere), die über Stock Connect gehandelt werden, können auch volatil und instabiler sein, wenn sie vom Handel ausgesetzt werden. Eine solche Aussetzung kann über einen beträchtlichen Zeitraum andauern, und Volatilität und Abrechnungsschwierigkeiten in Bezug auf die China-Connect-Wertpapiere können auch zu erheblichen Kursschwankungen führen und den Wert der China-Connect-Wertpapiere beeinträchtigen.

Unterschiedliche Handelstage. Stock Connect ist nur an Tagen in Betrieb, an denen die Märkte in der VRC und Hongkong für den Handel geöffnet sind, und wenn die Banken an den jeweiligen Märkten an den maßgeblichen Abrechnungstagen geöffnet sind. Infolgedessen kann der Fonds durch Anlagen über Stock Connect dem Risiko von Kursschwankungen bei China-Connect-Wertpapieren in den Zeiten, in denen kein Handel über das jeweilige Stock Connect stattfindet, ausgesetzt sein.

Operatives Risiko im Zusammenhang mit Stock Connect. Stock Connect ist abhängig vom Funktionieren der operativen Systeme der jeweiligen Marktteilnehmer. Marktteilnehmer können am jeweiligen Programm teilnehmen, wenn sie über bestimmte Informationstechnologien verfügen und Risikomanagement- und andere Anforderungen erfüllen, die von der jeweiligen Börse und/oder der jeweiligen Clearing-Haus festgelegt werden.

Stock Connect schreibt vor, dass die Marktteilnehmer ihre

operativen und technischen Systeme konfigurieren und anpassen. Ferner ist zu beachten, dass die Wertpapiersysteme und die rechtlichen Systeme in der VRC und Hongkong erheblich voneinander abweichen, und damit das Testprogramm funktioniert, Marktteilnehmer gegebenenfalls kontinuierlich Probleme lösen müssen, die sich aus diesen Unterschieden ergeben.

Außerdem erfordert die „Konnektivität“ bei Stock Connect eine Weiterleitung von Aufträgen zwischen der VRC und Hongkong. Die SEHK hat ein Auftragsweiterleitungssystem eingerichtet, das die grenzüberschreitenden Aufträge, die von Börsenteilnehmern eingegeben werden, zusammenfasst und weiterleitet. Es gibt keine Gewähr, dass die Systeme der SEHK und der Marktteilnehmer ordnungsgemäß funktionieren oder weiter an die Veränderungen und Entwicklungen der jeweiligen Märkte angepasst werden. Wenn die maßgeblichen Systeme nicht ordnungsgemäß funktionieren, könnte der Handel am jeweiligen Markt über das Programm unterbrochen werden. In einem solchen Fall wird der Fonds in seinen Möglichkeiten, über Stock Connect Zugang zum Markt für chinesische A-Aktien zu erhalten (und somit seine Anlagestrategie zu verfolgen) beeinträchtigt.

Beschränkungen bezüglich des Verkaufs aufgrund der vorgeschriebenen Prüfungen vor Orderfreigabe. Gemäß den Bestimmungen der VRC muss ein Anleger, der Aktien verkaufen will, über eine ausreichende Anzahl der betreffenden Aktien im Depot verfügen, andernfalls lehnt die SSE bzw. SZSE den betreffenden Verkaufsauftrag ab. Die SEHK prüft die Verkaufsaufträge ihrer Teilnehmer (d. h. der Aktienbroker) für China-Connect-Wertpapiere vor der Auftragsausführung, um sicherzustellen, dass es keinen Überverkauf gibt.

Wenn ein Fonds bestimmte China-Connect-Wertpapiere, die er hält, verkaufen will, muss er diese China-Connect-Wertpapiere auf die entsprechenden Konten seiner Makler übertragen, bevor der Markt am Verkaufstag öffnet. Wird diese Frist nicht eingehalten, können diese Aktien nicht am Handelstag verkauft werden. Aufgrund dieser Anforderung kann der Fonds seine Bestände an China-Connect-Wertpapieren möglicherweise nicht zeitnah verkaufen. Die Bestimmungen der VRC können bestimmte weitere Verkaufs- und Kaufbeschränkungen beinhalten, die dazu führen, dass ein Fonds Bestände an Connect-Wertpapieren nicht zeitnah veräußern kann. Dies wirft auch Fragen hinsichtlich des Kontrahentenrisikos auf, da Wertpapiere gegebenenfalls bis zum nächsten Tag bei Maklern gehalten werden.

Um Anlegern, deren SC-Wertpapiere bei Verwahrstellen gehalten werden, den Verkauf ihrer SC-Wertpapiere zu ermöglichen, ohne dass sie zunächst die SC-Wertpapiere von ihren Verwahrstellen an ihre ausführenden Makler liefern müssen, hat die SEHK im März 2015 ein Modell zur Prüfung vor Orderfreigabe eingeführt, unter dem ein Anleger seine Verwahrstelle anweisen kann, ein separates Sonderkonto (SPSA) zu eröffnen. Ein Anleger muss so alle relevanten SC-Wertpapiere erst nach Ausführung von seinem SPSA auf das Konto seines beauftragten Maklers übertragen, und nicht vor Erteilung des Verkaufsauftrags. Wenn der Fonds dieses Modell nicht nutzen kann, muss er die SC-Wertpapiere vor dem Handelstag an die Makler liefern, und es bestehen die vorstehend beschriebenen Risiken.

Ausschluss von Aktien aus dem zulässigen Aktienuniversum. Wird eine Aktie aus dem für den Handel

über Stock Connect zulässigen Aktienuniversum ausgeschlossen, kann sie lediglich verkauft werden, während Käufe nicht mehr möglich sind. Dies kann das Anlageportfolio oder die Strategien eines Fonds beeinträchtigen, wenn dieser beispielsweise eine Aktie kaufen will, die aus dem Universum der zulässigen Aktien ausgeschlossen wurde.

Clearing- und Abrechnungsrisiko im Zusammenhang mit Stock Connect. Als der nationale zentrale Kontrahent des Wertpapiermarktes der VRC betreibt die CSDCC ein umfassendes Netzwerk mit einer Clearing-, Abrechnungs- und Aktienverwahrungsinfrastruktur. In dem unwahrscheinlichen Fall, dass die CSDCC ihren Zahlungsverpflichtungen nicht nachkommt und ein Zahlungsausfall seitens der CSDCC festgestellt wird, beschränken sich die Verpflichtungen von HKSCC im Northbound-Handel unter seinen Marktverträgen mit Clearing-Teilnehmern darauf, die Clearing-Teilnehmer bei der Geltendmachung ihrer Ansprüche gegenüber der CSDCC zu unterstützen. In einem solchen Fall ist es möglich, dass sich der Beitreibungsprozess für betroffene Fonds verzögert oder dass diese ihre Verluste nicht vollständig betreiben können. Unter Stock Connect sollten die betreffenden Fonds, die SC-Wertpapiere erworben haben, diese SC-Wertpapiere auf den Kapitalkonten ihrer Makler oder Verwahrstellen bei dem von HKSCC betriebenen zentralen Clearing- und Abwicklungssystem CCASS halten.

Keine Absicherung durch Anlegerentschädigungsfonds. Die Anlagen des Fonds in SC-Wertpapieren unter SHHK und SZHK Stock Connect sind weder durch den Hongkonger Investor Compensation Fund noch durch den China Securities Investor Protection Fund gedeckt. Daher ist ein Fonds dem Ausfallrisiko des Maklers bzw. der Makler ausgesetzt, die er mit dem Handel von China-Connect-Wertpapieren über das jeweilige Programm beauftragt hat, und die Anleger profitieren nicht von einer Entschädigung aus solchen Programmen.

Wirtschaftliches Eigentum. Die genaue Art und die Rechte der Anleger aus Hongkong und anderen Ländern (einschließlich des Fonds) als wirtschaftliche Eigentümer von Anlagen in der VRC über Nominees ist unter dem Recht der VRC weniger gut definiert, und die genaue Art und die Methode der Durchsetzung der Rechte und Ansprüche solcher Anleger unter dem Recht der VRC sind nicht frei von Unklarheiten.

Insbesondere werden China-Connect-Wertpapiere bei der CSDCC gehalten. HKSCC ist ein Teilnehmer der CSDCC, und China-Connect-Wertpapiere, die vom Fonds erworben werden, werden (i) im Namen von HKSCC in dem von HKSCC bei der CSDCC eröffneten Nominee-Wertpapierkonto registriert, und HKSCC hält diese China-Connect-Wertpapiere als Nominee; und (ii) von der CSDCC verwahrt und im Aktionärsregister der an der SSE und SZSE notierten Unternehmen registriert.

HKSCC registriert die Rechte an diesen China-Connect-Wertpapieren auf dem Kapitalkonto des betreffenden CCASS-Clearing-Teilnehmers, sodass ein Fonds seine Rechte in Bezug auf China-Connect-Wertpapiere über den CCASS-Clearing-Teilnehmer und HKSCC als Nominee ausüben kann. In Bezug auf bestimmte Rechte und Ansprüche an China-Connect-Wertpapieren, die nur durch Klagen vor zuständigen Gerichten in der VRC ausgeübt bzw. geltend gemacht werden können, ist jedoch ungewiss, ob diese Rechte durchgesetzt werden können, da gemäß den

CCASS-Regelungen HKSCC als Nominee nicht verpflichtet ist, in der VRC oder anderswo eine Klage oder ein Gerichtsverfahren einzuleiten, um Rechte im Namen der Anleger für die China-Connect-Wertpapiere durchzusetzen.

RMB-Liquiditätsrisiko. Der RMB ist derzeit keine frei konvertierbare Währung. Der Kauf von SSE/SZSE-Aktien wird mit CNH finanziert. Die Nachfrage nach CNH kann steigen, und wenn ein Nettoabfluss von Offshore-RMB eintritt, kann sich die Liquidität des Offshore-RMB verknappen. Dies könnte zu steigenden Finanzierungskosten in CNH führen. Fonds, die Anlagen über SHHK und SZHK Stock Connect anstreben, können sich möglicherweise nicht ausreichend CNH sichern, um ihre Transaktionen durchzuführen, oder können dies möglicherweise nur zu hohen Kosten tun. Sollte die Regierung der VRC die Devisenkontrollen verschärfen, können solche Fonds zudem einem höheren Liquiditätsrisiko in Offshore-RMB ausgesetzt sein, sodass sie möglicherweise ihre Anlagestrategien nicht mehr effektiv verfolgen können.

Mit dem Offshore-Markt verbundene Risiken. Der RMB, der im Onshore-Markt gehandelt wird (d. h. der CNY) kann zu einem anderen Wechselkurs gehandelt werden als der RMB, der im Offshore-Markt gehandelt wird (d. h. der CNH). Die Anlagen der Fonds könnten sowohl dem CNY als auch dem CNH ausgesetzt sein, und die Fonds können deshalb einem größeren Wechselkursrisiko und/oder höheren Anlagekosten ausgesetzt sein (beispielsweise bei einer Konvertierung anderer Währungen in den RMB zum CNH-Wechselkurs).

Fonds, deren Basiswährung nicht der RMB ist, können auch aufgrund der Notwendigkeit der Umrechnung in RMB bei Anlagen in SC-Wertpapieren einem Währungsrisiko ausgesetzt sein. Bei einer solchen Umrechnung können einem Fonds auch Währungsumrechnungskosten entstehen. Der Wechselkurs kann Schwankungen unterliegen, und wenn der RMB an Wert verloren hat, kann einem Fonds ein Verlust entstehen, wenn er den Verkaufserlös von SC-Wertpapieren in seine operative Währung umrechnet.

Beschränkungen des Daytrading. Daytrading oder Turnaround-Trading ist auf dem Markt für chinesische A-Aktien nicht erlaubt. Daher können die Fonds, die SC-Wertpapiere am Tag T kaufen, diese Aktien erst am und nach dem Tag T+1 verkaufen und unterliegen dabei den Regeln des Stock-Connect-Programms. Dies schränkt die Anlegeoptionen der Fonds ein, insbesondere, wenn ein Fonds SC-Wertpapiere an einem bestimmten Handelstag verkaufen will. Die Anforderungen an Abrechnung und Prüfung vor Orderausführung können sich jederzeit ändern.

Rangfolge von Aufträgen. Wenn ein Makler für seine Kunden Dienstleistungen in Bezug auf den Handel über Stock Connect anbietet, können Eigengeschäfte des Maklers oder seiner verbundenen Unternehmen unabhängig an das Handelssystem übermittelt werden, ohne dass die Händler Informationen über den Status der von Kunden erhaltenen Aufträge haben. Es ist nicht gewährleistet, dass Makler die Rangfolge von Kundenaufträgen (gemäß geltenden Gesetzen und Bestimmungen) einhalten.

Risiko im Zusammenhang mit der besten Ausführung. Nach den maßgeblichen Bestimmungen in der VRC können Wertpapierhandelstransaktionen unter einem bzw. Zugangsprogramm(en) über eine begrenzte Anzahl von

Maklern bzw. Handels- und Abrechnungsvertretern der VRC durchgeführt werden und dementsprechend die beste Ausführung solcher Transaktionen beeinflusst werden. Ist der Anlageverwalter aus irgendeinem Grund nicht in der Lage, den betreffenden Makler bzw. Handels- und Abrechnungsvertreter in der VRC in Anspruch zu nehmen, kann dies den Betrieb des betreffenden Fonds beeinträchtigen. Dem Fonds können ferner Verluste durch Handlungen oder Unterlassungen seitens des/der Makler(s) in der VRC bzw. des Handels- und Abrechnungsvertreters bei der Ausführung oder Abrechnung einer Transaktion oder der Übertragung von Geldern oder Wertpapieren entstehen. Der Anlageverwalter wird jedoch bei der Auswahl der Makler bzw. Handels- und Abrechnungsvertreter in der VRC auf Faktoren wie die Wettbewerbsfähigkeit der Provisionssätze, die Größe der relevanten Aufträge und die Ausführungsstandards achten. Es ist möglich, dass nur ein einziger Makler bzw. Handels- und Abrechnungsvertreter ernannt wird und der betreffende Fonds nicht unbedingt die niedrigste am Markt verfügbare Provision zahlt. Es besteht das Risiko, dass dem betreffenden Fonds durch einen Zahlungsausfall oder eine Insolvenz des Maklers bzw. Handels- und Abrechnungsvertreters oder einen Ausschluss desselben von seiner Tätigkeit Verluste entstehen. In einem solchen Fall können dem Fonds bei der Ausführung von Transaktionen über einen solchen Makler bzw. Handels- und Abrechnungsvertreter Nachteile entstehen. Ferner kann der Makler Anlageaufträge mit seinen eigenen und den Aufträgen seiner verbundenen Unternehmen sowie mit denjenigen seiner übrigen Kunden, einschließlich der Fonds, zusammenfassen. In manchen Fällen kann eine Zusammenfassung für die Fonds nachteilig sein und in anderen Fällen vorteilhaft.

Risiko im Zusammenhang mit begrenztem außerbörslichem Handel und Übertragungen. SC-Wertpapiere dürfen im Allgemeinen ausschließlich über Stock Connect und gemäß den Stock-Connect-Regeln ge- und verkauft und anderweitig übertragen werden. „Non-Trade“-Übertragungen (d. h. außerbörslicher Handel und außerbörsliche Übertragungen) sind unter begrenzten Umständen zulässig, etwa bei der Zuordnung von chinesischen A-Aktien zu verschiedenen Fonds/Teilfonds durch Fondsmanager nach der Transaktion oder der Korrektur von Transaktionsfehlern.

Risiken im Zusammenhang mit Kapitalmaßnahmen und Aktionärsversammlungen. HKSCC erhebt zwar keinen Anspruch auf Eigentumsrechte an den in seinen Sammelkapitalkonten bei der CSDCC gehaltenen China-Stock-Connect-Wertpapieren, ist jedoch eingetragener Aktionär von an der SSE oder SZSE notierten Unternehmen (in seiner Eigenschaft als Nominee für Anleger in Hongkong und anderen Ländern) und kann als Aktionär in Bezug auf solche China-Connect-Wertpapiere an Aktionärsversammlungen teilnehmen. Wenn die Satzung eines börsennotierten Unternehmens nicht die Ernennung eines oder mehrerer Stellvertreter durch seinen Aktionär verbietet, kann HKSCC Arrangements treffen, um einen oder mehrere Anleger als seine Stimmrechts- oder Stellvertreter zu ernennen, die auf entsprechende Weisung an Aktionärsversammlungen teilnehmen. Ansonsten können gemäß der aktuellen Marktpraxis in der VRC Anleger, die im Northbound-Handel aktiv sind, generell nicht über einen Stimmrechtsvertreter und auch nicht persönlich an Aktionärsversammlungen teilnehmen, und die Fonds werden nicht in der Lage sein, ihre Stimmrechte in den Unternehmen, in denen sie angelegt haben, in gleicher Weise auszuüben, wie es in einigen Industrieländern vorgesehen ist.

Kapitalmaßnahmen in Bezug auf China-Connect-Wertpapiere werden vom betreffenden Emittenten über die Website der SSE bzw. SZSE sowie über bestimmte offiziell festgelegte Zeitungen bekannt gegeben. An der SSE und SZSE notierte Emittenten veröffentlichen jedoch Unternehmensdokumente nur in chinesischer Sprache, englische Übersetzungen werden nicht verfügbar sein.

HKSCC wird CCASS-Teilnehmer über Kapitalmaßnahmen von China-Connect-Wertpapieren auf dem Laufenden halten. Anleger aus Hongkong und anderen Ländern (einschließlich Fonds) müssen die von ihren jeweiligen Maklern oder Verwahrstellen (d. h. CCASS-Teilnehmern) vorgegebenen Arrangements und Fristen einhalten. Gegebenenfalls beträgt bei einigen Arten von Kapitalmaßnahmen die Frist, die sie haben, um Maßnahmen zu treffen, nur einen Geschäftstag. Daher sind Fonds möglicherweise nicht in der Lage, rechtzeitig an Kapitalmaßnahmen teilzunehmen.

QFI-Risiko. Die Rückführung von RMB durch QFIs im Falle offener Investmentfonds ist derzeit auf Tagesbasis zulässig und unterliegt weder Rückführungsbeschränkungen noch einer vorherigen behördlichen Genehmigung. Die Anwendung und Auslegung der einschlägigen Anlagevorschriften sind relativ unerprobt, und es besteht Unsicherheit darüber, wie sie angewendet werden sollen, da den Behörden und Aufsichtsbehörden der VRC in Bezug auf diese Anlagevorschriften ein weitreichender Ermessensspielraum eingeräumt wurde und es nur begrenzt Präzedenzfälle bzw. eine begrenzte Sicherheit darüber gibt, wie diese Ermessensspielräume aktuell oder in Zukunft ausgeübt werden könnten. Es ist nicht möglich vorherzusehen, wie sich das QFI-System künftig entwickeln wird. Etwaige Rückführungsbeschränkungen, die für QFI-Investitionen des betreffenden Fonds auferlegt werden, können sich nachteilig auf die Fähigkeit des Fonds auswirken, Rücknahmeanträgen nachzukommen. Jegliche Änderung des QFI-Systems im Allgemeinen, einschließlich der Möglichkeit, dass der QFI seinen QFI-Status verliert, kann die Fähigkeit des betreffenden Fonds beeinträchtigen, in zulässige Wertpapiere in der VRC direkt über den betreffenden QFI zu investieren. Darüber hinaus kann die Wertentwicklung des betreffenden Fonds nachteilig beeinflusst werden, wenn der QFI-Status ausgesetzt oder aufgehoben wird, da der betreffende Fonds verpflichtet sein könnte, seine bislang gemäß QFI-Regelung zulässigen Wertpapierbestände zu veräußern.

Mit Bond Connect als neuem Programm verbundene Risiken. Bond Connect ist ein neuartiges Handelsprogramm in China. Die Anwendung und Auslegung der einschlägigen Anlagevorschriften sind weitgehend unerprobt und es gibt keine Sicherheit oder Orientierungshilfe in Bezug darauf, wie einzelne Bestimmungen der einschlägigen Anlagevorschriften in der Praxis angewandt und ausgelegt werden. Die einschlägigen Anlagevorschriften lassen den zuständigen Aufsichtsbehörden der VRC (insbesondere PBoC und SAFE) einen gewissen Ermessensspielraum. Dafür, wie dieser jetzt oder in Zukunft ausgeübt wird, gibt es nur begrenzte Präzedenzfälle oder Gewissheit. Darüber hinaus entwickeln sich die einschlägigen Anlagevorschriften, denen zufolge ein Fonds über Bond Connect anlegen darf, noch weiter, und es kann nicht zugesichert werden, dass die einschlägigen Anlagevorschriften nicht so geändert werden, dass es den Interessen des betreffenden Fonds schadet.

Ferner weisen Bond Connect, seine Technologie und seine Risikomanagementkapazitäten nur eine sehr kurze

bisherige Betriebslaufzeit auf. Es kann nicht zugesichert werden, dass die Systeme und Kontrollen des Bond-Connect-Programms wie vorgesehen funktionieren oder angemessen sind.

Mit Bond Connect verbundenes aufsichtsrechtliches Risiko. Alle Gesetze, Regelungen, Vorschriften, Richtlinien, Mitteilungen, Rundschreiben oder Leitlinien, die von einer der Bond-Connect-Stelle veröffentlicht oder angewendet werden, (die „**geltenden Bond-Connect-Gesetze und -Regelungen**“) könnten sich in Bezug auf Bond Connect oder jede sich aus Bond Connect ergebende Tätigkeit von Zeit zu Zeit ändern. Es kann nicht zugesichert werden, dass Bond Connect nicht abgeschafft wird. Der betreffende Fonds kann durch Änderungen der geltenden Bond-Connect-Gesetze und -Regelungen beeinträchtigt werden.

Keine außerbörsliche Übertragung. Gemäß den geltenden Bond-Connect-Gesetzen und -Regelungen ist die Übertragung von Bond-Connect-Wertpapieren zwischen zwei CMU-Mitgliedern und zwischen zwei CMU-Unterkonten desselben CMU-Mitglieds unzulässig.

Keine Orderänderung, begrenzte Orderstornierung. Gemäß den geltenden Bond-Connect-Gesetzen und -Regelungen dürfen Anweisungen zu Verkaufs- und Kauforders für Bond-Connect-Wertpapiere nur unter bestimmten Umständen gemäß den geltenden Bond-Connect-Gesetzen und -Regelungen storniert und nicht geändert werden.

Sicherungsgeschäfte. Sicherungsgeschäfte unterliegen den geltenden Bond-Connect-Gesetzen und -Regelungen und der herrschenden Marktpraxis. Es gibt keine Garantie dafür, dass der betreffende Fonds in der Lage sein wird, Sicherungsgeschäfte zu für die Verwaltungsgesellschaft und den jeweiligen Anlageberater annehmbaren Bedingungen abzuschließen. Möglicherweise muss der Fonds seine Sicherungsgeschäfte zu ungünstigen Marktbedingungen abwickeln.

Nominee-Halte-Struktur. Bond-Connect-Wertpapiere werden von der CMU gehalten. Dafür werden zwei Nominee-Konten bei CCDC und SHCH eröffnet. Die unterschiedlichen Konzepte vom „bevollmächtigten Inhaber“ (Nominee Holder) und vom „wirtschaftlichen Eigentümer“ werden gemäß geltenden Bond-Connect-Gesetzen und -Regelungen zwar generell anerkannt, doch die Anwendung solcher Regelung ist unerprobt, und es kann nicht zugesichert werden, dass Gerichte in der VRC solche Regelungen anerkennen, beispielsweise in Liquidationsverfahren von VRC-Unternehmen oder anderen Gerichtsverfahren.

Mit dem Ausfall von CMU/ CDC/SHCH verbundenes Risiko. Ein Ausfall oder Verzug von CMU, CCDC oder SHCH bei der Erfüllung ihrer jeweiligen Pflichten kann dazu führen, dass CIBM- und/oder andere Gelder im Zusammenhang mit diesen nicht abgerechnet werden oder verloren gehen. Der betreffende Fonds kann infolgedessen Verluste erleiden.

Kontrahentenrisiko durch die Unterdepotbank in der VRC und andere Verwahrstellen für Anlagen in der VRC. Anlagen in der VRC, die über ein Zugangsprogramm/Zugangsprogramme erworben werden, werden durch die VRC-Unterdepotbank in elektronischer Form über das/die Wertpapierkonto/Wertpapierkonten verwahrt, und liquide Mittel werden auf einem oder mehreren RMB-Barkonten bei der VRC-Unterdepotbank gehalten. Das/die Wertpapierkonto/-konten und das/die Renminbi-Barkonto/-konten für den jeweiligen Fonds in der VRC werden nach gängiger Marktpraxis geführt. Solche Konten

können auf den Namen eines Nominee (z. B. des QFI/Antragstellers gemäß dem bzw. den CIBM Direct Access Programme(s)) anstatt auf den Namen des betreffenden Fonds lauten, und die Vermögenswerte auf solchen Konten können für und im Namen von Kunden des Nominee, u. a. auch für und im Namen eines solchen Fonds gehalten werden. Auch wenn die chinesischen Aufsichtsbehörden bestätigt haben, dass sie die Konzepte von Nominees und wirtschaftlich Berechtigten anerkennen und in der VRC anwendbare Regeln, Vorschriften und sonstige verwaltungsrechtliche Maßnahmen und Vorkehrungen allgemein das Konzept eines „Nominees“ vorsehen und das Konzept eines „wirtschaftlich Berechtigten“ von Wertpapieren anerkennen, sind diese Konzepte im chinesischen Rechtssystem relativ neu und im Rahmen des QFI-Regimes noch nicht erprobt. Daher können die auf einem solchen Konto gehaltenen Vermögenswerte des betreffenden Fonds dem Risiko ausgesetzt sein, dass sie als Teil des Vermögens des Nominees betrachtet werden und im Falle einer Insolvenz des Nominees anfällig für Forderungen von Gläubigern des Nominees sind. Auch wenn die auf solchen Konten gehaltenen Vermögenswerte von den Vermögenswerten des Nominees getrennt sind und separat gehalten werden und ausschließlich dem betreffenden Fonds gehören, ist es möglich, dass die Justiz- und Aufsichtsbehörden in der VRC diese Position in Zukunft anders auslegen. Zudem ist es möglich, dass die Vermögenswerte des Fonds nicht ausreichend von den Vermögenswerten anderer Fonds, anderen Geldern oder anderen Kunden, die über den Nominee anlegen, getrennt werden. Dem betreffenden Fonds können ferner Verluste durch Handlungen oder Unterlassungen seitens der VRC-Unterdepotbank bei der Ausführung oder Abrechnung einer Transaktion oder der Übertragung von Geldern oder Wertpapieren entstehen.

Bei der VRC-Unterdepotbank auf einem oder mehreren Barkonten gehaltene liquide Mittel werden in der Praxis nicht getrennt, sondern stellen vielmehr eine Schuld der VRC-Unterdepotbank gegenüber dem betreffenden Fonds als Einleger dar. Solche Barmittel können mit den Barmitteln anderer Kunden der VRC-Unterdepotbank vermischt werden. Im Falle einer Insolvenz der VRC-Unterdepotbank hat der betreffende Fonds keine Eigentumsrechte an den auf solchen Geldkonten, die bei der VRC-Unterdepotbank eröffnet wurden, gehaltenen Barmitteln, und der Fonds wird ein ungesicherter Gläubiger, der gleichrangig mit allen anderen ungesicherten Gläubigern der VRC-Unterdepotbank ist. Dem Fonds könnten Schwierigkeiten und/oder Verzögerungen bei der Beitreibung solcher Verbindlichkeiten entstehen oder er könnte nicht in der Lage sein, diese vollständig oder überhaupt beizutreiben. In diesem Fall verliert der Fonds seine Barmittel teilweise oder ganz.

Kontrahentenrisiko gegenüber Maklern bzw. Handels- und Abrechnungsvertretern in der VRC. Nach den maßgeblichen Bestimmungen in der VRC können Wertpapierhandelstransaktionen unter dem bzw. den Zugangsprogramm(en) über eine begrenzte Anzahl von Maklern bzw. Handels- und Abrechnungsvertretern der VRC durchgeführt werden, die für den Handel an einer Börse in der VRC oder am Interbanken-Anleihenmarkt für den betreffenden Fonds ernannt werden. Kann aus irgendeinem Grund der betreffende Makler bzw. Handels- und Abrechnungsvertreter in der VRC nicht in Anspruch genommen werden, so kann dies den Betrieb des betreffenden Fonds beeinträchtigen. Dem Fonds können ferner Verluste durch Handlungen oder Unterlassungen

seitens des/der Makler(s) in der VRC bzw. des Handels- und Abrechnungsvertreters bei der Ausführung oder Abrechnung einer Transaktion oder der Übertragung von Geldern oder Wertpapieren entstehen. Bei der Auswahl der Makler bzw. Handels- und Abrechnungsvertreter in der VRC sind jedoch Faktoren wie die Wettbewerbsfähigkeit der Provisionssätze, die Größe der relevanten Aufträge und die Ausführungsstandards zu beachten. Es ist möglich, dass nur ein einziger Makler bzw. Handels- und Abrechnungsvertreter ernannt wird und der betreffende Fonds nicht unbedingt die niedrigste am Markt verfügbare Provision zahlt. Es besteht das Risiko, dass dem betreffenden Fonds durch einen Zahlungsausfall oder eine Insolvenz des Maklers bzw. Handels- und Abrechnungsvertreters oder einen Ausschluss desselben von seiner Tätigkeit Verluste entstehen. In einem solchen Fall können dem Fonds bei der Ausführung von Transaktionen über einen solchen Makler bzw. Handels- und Abrechnungsvertreter Nachteile entstehen. Ein Fonds kann direkt oder indirekt nachteilig betroffen sein von (i) den Handlungen bzw. Unterlassungen des Maklers/Handels- und Abrechnungsvertreters bei der Abrechnung von Transaktionen oder der Übertragung von Geldern oder Wertpapieren; (ii) dem Ausfall oder Konkurs des Maklers/Handels- und Abrechnungsvertreters, und (iii) dem vorübergehenden oder dauerhaften Ausschluss des Maklers/Handels- und Abrechnungsvertreters von seiner entsprechenden Funktion. Solche Handlungen, Unterlassungen, Konkurse oder Ausschlüsse können einen Fonds auch in der Umsetzung seiner Anlagestrategie beeinträchtigen oder seinen Betrieb stören, u. a. durch Verzögerungen bei der Abrechnung von Transaktionen oder der Übertragung von Geldern oder Wertpapieren in der VRC oder bei der Beitreibung von Vermögenswerten. Dies wiederum kann sich negativ auf seinen Nettoinventarwert auswirken. Ferner können gegen den Makler/Handels- und Abrechnungsvertreter aufsichtsrechtliche Sanktionen verhängt werden, wenn dieser gegen Bestimmungen des Zugangsprogramms bzw. der Zugangsprogramme verstößt. Solche Sanktionen können negative Auswirkungen für die Anlagen des Fonds in der VRC haben.

Transfers und Rückführungen von RMB. Zeichnungs-, Rücknahme- und/oder Umtauschanträge für Anteile können unter dem bzw. den maßgeblichen Zugangsprogramm(e) und anderen maßgeblichen Bestimmungen in der VRC bestimmten Beschränkungen unterliegen. Die Rückführung von investiertem Kapital und Erträgen sowie von Kapitalerträgen eines Fonds aus der VRC unterliegt den jeweils geltenden maßgeblichen Bestimmungen in der VRC.

Die Rückführung von RMB durch QFIs für offene Fonds ist derzeit auf täglicher Basis auf der Grundlage von Nettozeichnungen und -rücknahmen von Anteilen des betreffenden Fonds (als offener Fonds) zulässig und unterliegt keinen Rückführungsbeschränkungen, Sperrfristen oder vorherigen behördlichen Genehmigungen (allerdings sehr wohl Authentizitäts- und Compliance-Prüfungen und anderen aufsichtsbehördlichen Anforderungen). Derzeit gibt es unter den oben genannten Umständen für die Rückführung von Geldern von QFIs keine Erfordernis einer vorherigen behördlichen Genehmigung. Allerdings gibt es keine Garantie, dass sich die Regeln und Vorschriften der VRC nicht ändern oder dass in Zukunft keine Rückführungsbeschränkungen auferlegt werden. Darüber hinaus können solche Änderungen an den Regeln und Vorschriften der VRC rückwirkend eingeführt werden.

Überweisungen und Rückführungen auf Rechnung eines Fonds im Rahmen des bzw. der CIBM Direct Access

Programme(s) können derzeit vorbehaltlich der folgenden Beschränkungen durchgeführt werden:

- (i) ein Fonds kann Anlagekapital in RMB oder einer Fremdwährung in die VRC für Anlagen über das bzw. die CIBM Direct Access Programme(s) transferieren; und
- (ii) wenn ein Fonds Gelder aus der VRC zurückführt, sollte das Verhältnis von RMB zu Fremdwährung im Allgemeinen dem Verhältnis von RMB zu Fremdwährung entsprechen, das vorherrschte, als das Anlagekapital ursprünglich in die VRC transferiert wurde, wobei eine maximal zulässige Abweichung von 10 % Anwendung findet. Auf diese Anforderung an das Verhältnis kann bei der ersten Rückführung verzichtet werden, sofern die zu repatriierende Fremdwährung oder das zu repatriierende RMB-Kapital 110 % des in die VRC eingezahlten Fremdwährungs- oder RMB-Betrags insgesamt nicht überschreitet. Soweit die Rückführung in der gleichen Währung erfolgt wie der eingehende Transfer, entfällt die Beschränkung im Hinblick auf den Wechselkurs.

Die Vorschriften über die Rückführung von Kapital und Gewinnen können möglicherweise auf die QFIs als Ganzes angewendet werden. Daher kann die Fähigkeit eines Fonds, Anlagen zu tätigen und/oder Gelder von QFIs rückzuführen, durch die Anlagen, die Performance und/oder die Rückführung von Geldern, die von anderen Anlegern über die QFIs investiert wurden, beeinträchtigt werden.

Rückführungsbeschränkungen, die gegebenenfalls nach den Bestimmungen in der VRC in der Zukunft gelten, könnten die Möglichkeiten des Fonds einschränken, alle oder einen Teil der Rücknahmeanträge für einen bestimmten Rücknahmetag auszuführen, und dementsprechend kann der Fonds aufgrund hoher Barbestände und der Verhängung der o. g. Rücknahmebeschränkungen mit Schwierigkeiten beim Liquiditätsmanagement konfrontiert sein.

Da die Überprüfung der Authentizität und Konformität durch die VRC-Unterdepotbank bei jeder Rückführung durchgeführt wird, kann die Rückführung durch die VRC-Unterdepotbank im Falle einer Nichteinhaltung der QFI-Regeln und -Vorschriften verzögert oder sogar abgelehnt werden. In solchen Fällen wird davon ausgegangen, dass der Rücknahmeerlös so schnell wie praktikabel und nach Abschluss der Rückführung der betreffenden Gelder an den rückgebenden Anteilinhaber gezahlt wird. Der tatsächliche Zeitaufwand für den Abschluss der betreffenden Rückführung entzieht sich der Kontrolle des QFI.

Auswirkungen der Bestimmungen in der VRC auf Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausche. Die Möglichkeiten eines Anteilinhabers, Anteile eines Fonds zurückzugeben, sind unter anderem von den Gesetzen und Gepflogenheiten in der VRC abhängig, die sich auf die Fähigkeit des Fonds auswirken, Anlagen zu liquidieren und die Erlöse aus der VRC rückzuführen. Rückführungsbeschränkungen, die gegebenenfalls nach den Bestimmungen in der VRC in der Zukunft gelten, könnten die Möglichkeiten des Fonds einschränken, alle oder einen Teil der Rücknahmeanträge für einen bestimmten Rücknahmetag auszuführen, und dementsprechend kann der Fonds aufgrund hoher Barbestände und der Verhängung der o. g. Rücknahmebeschränkungen mit Schwierigkeiten beim

Liquiditätsmanagement konfrontiert sein. Anleger sollten nicht in den Fonds anlegen, wenn sie eine höhere Liquidität benötigen als vom Fonds geboten.

Zeichnungs- und/oder Umtauschanträge für Anteile können davon abhängig sein, ob unter dem bzw. den maßgeblichen Zugangsprogramm(e) in Kombination mit der Anlagepolitik und den Anlagebeschränkungen des betreffenden Fonds ausreichend Kapazitäten für einen Fonds vorhanden sind. Zeichnungs- und/oder Umtauschanträge, die in einer Phase eingehen, in der für den betreffenden Fonds nicht ausreichend Kapazitäten z. B. im Rahmen von QFIs zur Verfügung stehen, können ausgesetzt und am nächsten Zeichnungstag bearbeitet werden, an dem wieder ausreichend Kapazitäten für den Fonds zur Verfügung stehen. Ferner kann der Verwaltungsrat (oder seine ordnungsgemäß bevollmächtigte(n) Vertreter) Anträge ablehnen und Anträge, die in einer Phase eingehen, in der für den betreffenden Fonds nicht ausreichend Kapazitäten gemäß dem bzw. dem bzw. den QFI/CIBM Direct Access Programme(s) zur Verfügung stehen, vorübergehend oder dauerhaft aussetzen oder beschränken.

Unbeschadet des Vorstehenden kann der Verwaltungsrat (oder dessen ordnungsgemäß bevollmächtigte(r) Vertreter) beschließen, die Ausgabe, Zeichnung, Rücknahme, den Umtausch, die Zahlung von Rücknahmeerlösen und/oder die Bewertung von Anteilen des betreffenden Fonds in einer Phase, in der der Fonds nicht in der Lage ist, Zeichnungserlöse von den bzw. auf die Konten des Fonds zu transferieren oder Positionen zu verkaufen oder die Erlöse solcher Verkäufe, die bestimmten von einer Regulierungs-, Aufsichts-, Regierungs- oder staatsähnlichen Behörde, einer Steuerbehörde oder einer Selbstregulierungsorganisation (staatlicher oder sonstiger Natur) verhängten Quoten oder Limits unterliegen, rückzuführen, vorübergehend auszusetzen, z. B. wenn Zeichnungserlöse nicht auf das Konto des betreffenden Fonds transferiert werden können, weil der Fonds nicht in der Lage ist, Positionen in dem bzw. den maßgeblichen Zugangsprogramm(en) zu verkaufen oder die Erlöse solcher Verkäufe rückzuführen.

Kauf- und Verkaufsinformationen Primärmärkte

Zeichnung von ETF-Anteilen. Die nachfolgenden Bestimmungen gelten ausschließlich für die Zeichnung von ETF-Anteilen, die direkt bei der Gesellschaft vorgenommen wird, und nicht für den Erwerb von ETF-Anteilen an Sekundärmärkten. Zeichnungsanträge für ETF-Anteile direkt der Gesellschaft gegenüber können nur von autorisierten Teilnehmern gestellt werden. Alle anderen Anleger müssen ETF-Anteile im Sekundärmarkt über die autorisierten Teilnehmer erwerben, wie im nachfolgenden Abschnitt „Sekundärmarkt - Käufe und Verkäufe am Sekundärmarkt“ beschrieben. Diese Einschränkung gilt nicht für Nicht-ETF-Anteile, die direkt von der Gesellschaft an alle potenziellen Anleger ausgegeben werden können. ETF-Anteilszeichnungen für einen Fonds könne nach Ermessen des Verwaltungsrats in bar, in Sachwerten oder in einer Kombination aus beidem erfolgen.

Zeichnung von Nicht-ETF-Anteilen. Die nachfolgenden Bestimmungen gelten auch für die Zeichnung von Nicht-ETF-Anteilen direkt bei der Gesellschaft. Es wird nicht erwartet, dass es einen Sekundärmarkt für Nicht-ETF-Anteile geben wird. Zeichnungen für Nicht-ETF-Anteile in einem Fonds können auf die im maßgeblichen Nachtrag beschriebene Weise erfolgen. Sie können, nach Maßgabe des Verwaltungsrats in bar, in Sachwerten oder als eine Kombination aus beidem erfolgen.

Sofern in diesem Prospekt nichts Abweichendes festgelegt ist, sieht der Fonds keine Beschränkungen der Häufigkeit von Zeichnungen und Rücknahmen vor. Der Verwaltungsrat kann jedoch nach seinem alleinigen Ermessen die Annahme von Anteilszeichnungen ganz oder teilweise ablehnen.

Erstzeichnungen. Die Anteile eines Fonds werden bei Erstausgabe zu dem im maßgeblichen Nachtrag genannten Preis ausgegeben und danach zum Nettoinventarwert je Anteil, der im maßgeblichen Nachtrag genannt ist. Anteilszeichnungen werden bei Eingang eines ausgefüllten Zeichnungsantrags beim Administrator berücksichtigt. Dieser Antrag muss den Anforderungen für Zeichnungsanträge entsprechen, insbesondere im Hinblick auf die Unterlagen zur Geldwäscheprüfung, und muss mit frei verfügbaren Geldern und/oder anderen geeigneten Gegenleistungen, wie nachfolgend beschrieben, abgerechnet werden. Diese Anteile werden nach dem Zeichnungsschluss des Erstausgabezeitraums gemäß den Bestimmungen des maßgeblichen Nachtrags ausgegeben.

Potenzielle Anleger sollten beachten, dass sie mit Ausfüllen des Antragsformulars personenbezogene Daten an den Fonds weitergeben, bei denen es sich um personenbezogene Daten im Sinne der irischen Datenschutzgesetze handeln kann. Die personenbezogenen Daten potenzieller Anleger und registrierter Anteilinhaber werden gemäß der Datenschutzerklärung verarbeitet.

Folgezeichnungen. Anteilinhaber können Folgezeichnungen für Anteile eines Fonds des Administrators per Fax oder E-Mail in einem Format bzw. nach einer Methode, das/die zuvor schriftlich mit dem r Verwaltungsstelle vereinbart wurde und den Anforderungen

der Zentralbank entspricht, übermitteln, ohne dass die Originalunterlagen vorgelegt werden müssen.

Mindestzeichnungsbeträge. Anteilinhaber, die nach einem der nachfolgend beschriebenen Verfahren Anteile zeichnen möchten, müssen einen Betrag zeichnen, der mindestens dem Mindestzeichnungsbetrag entspricht. Der Mindestzeichnungsbetrag kann für Erstzeichnungen und Folgezeichnungen unterschiedlich sein, und der Verwaltungsrat nach seinem alleinigen Ermessen bzw. seine bevollmächtigten Vertreter können auf dessen Anwendung verzichten. Der Mindestzeichnungsbetrag für die einzelnen Fonds ist in den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer festgelegt.

Antragsformulare. Die unterzeichneten Zeichnungsformulare und die Begleitunterlagen zur Geldwäscheprüfung sind dem Administrator im Original nach den im Zeichnungsformular enthaltenen Anweisungen per Post zu übersenden. Änderungen an den Registrierungsangaben und den Zahlungsanweisungen eines Anteilinhabers werden erst bei Erhalt der Originaldokumente wirksam.

Barzeichnungen. Anleger können Anteile gegen Barzahlung an jedem Handelstag zeichnen, indem sie bis zu dem für den jeweiligen Fonds im maßgeblichen Nachtrag festgelegten Orderannahmeschluss einen entsprechenden Antrag stellen. Ordnungsgemäß gestellte Anträge, die nach dem im maßgeblichen Nachtrag festgelegten Zeitpunkt beim Administrator eingehen, werden als am folgenden Handelstag eingegangen behandelt, unter dem Vorbehalt, dass die Verwaltungsgesellschaft in außergewöhnlichen Umständen beschließen kann, Zeichnungen nach dem betreffenden Orderannahmeschluss anzunehmen, wenn sie vor dem maßgeblichen Bewertungszeitpunkt eingegangen sind. Zeichnungsgelder in der Währung, auf die die betreffenden Anteile lauten, sind per Überweisung auf das im Antragsformular genannte Konto bis zu dem im nachmaßgeblichen Nachtrag genannten Zeitpunkt zu zahlen. Gehen die Zeichnungsgelder (einschließlich aller Abgaben und Gebühren) nicht bis zu dem im maßgeblichen Nachtrag festgelegten Zeitpunkt und Datum als frei verfügbare Gelder bei der Gesellschaft ein, behält sich die Verwaltungsgesellschaft das Recht vor, vorläufige Zuteilungen von Anteilen zu stornieren, und kann versuchen, der Gesellschaft jeweils für die Zuteilung angefallene Kreditkosten zurückzuerlangen.

Zeichnung von ETF-Anteilen gegen Sachwerte. Jeder Fonds ermöglicht Anlegern an jedem Handelstag ETF-Anteile gegen Sachwerte zu zeichnen, sofern im maßgeblichen Nachtrag nichts anderes festgelegt ist (und nicht während Zeiten, während denen die Berechnung des Nettoinventarwerts pro Anteil ausgesetzt ist). „In Sachwerten“ bedeutet in diesem Kontext, dass anstelle der Entgegennahme von Barmitteln für eine Zeichnung die Gesellschaft Wertpapiere (oder überwiegend Wertpapiere) und eine Barkomponente entgegennimmt.

Zeichnungen für ETF-Anteile, die beim Administrator vor dem im maßgeblichen Nachtrag festgelegten Orderannahmeschluss an einem Handelstag eingehen, werden an diesem Handelstag angenommen und gemäß

den Bestimmungen des maßgeblichen Nachtrags bearbeitet, unter dem Vorbehalt, dass die Verwaltungsgesellschaft in außergewöhnlichen Umständen beschließen kann, Zeichnungen nach dem jeweiligen Orderannahmeschluss anzunehmen, wenn sie vor dem maßgeblichen Bewertungszeitpunkt eingegangen sind.

Die Zeichnung von ETF-Anteilen gegen Sachwerte kann von Anlegern auf zwei Weisen getätigt werden. Erstens kann die Abrechnung in Form eines Korbes von Wertpapieren und einer Barkomponente erfolgen, der vom Anlageverwalter so zusammengestellt wird, dass er sich in seiner Zusammensetzung eng an dem betreffenden Fonds orientiert (so dass der Anlageverwalter nach Abschluss der Zeichnung keine weiteren wesentlichen Schritte in Form von zusätzlichen Käufen oder Verkäufen von Wertpapieren oder Anpassungen anderer Positionen, die in Bezug auf den betreffenden Fonds gehalten werden, vornehmen muss, um die Zusammensetzung des Fonds neu auszurichten) (ein „**fester Portfolio-Korb**“). Die Zusammensetzung des von einem Anleger zu liefernden festen Portfolio-Korbes und eines geschätzten Barbetrages werden handelstäglich auf der Website veröffentlicht.

Zweitens kann die Abrechnung in Form eines Korbes von Wertpapieren erfolgen, auf die sich der Anleger und der Anlageverwalter aus einer vom Anlageverwalter als für die Umsetzung des Anlageziels des Fonds geeignet identifizierten Liste einigen (wobei dies jedoch erforderlich machen kann, dass der Anlageverwalter weitere Schritte in Form von zusätzlichen Käufen oder Verkäufen von Wertpapieren oder Anpassungen anderer in Bezug auf den betreffenden Fonds gehaltener Positionen vornimmt, um die Zusammensetzung des Fonds neu auszurichten), plus einer Barkomponente (ein „**ausgehandelter Portfolio-Korb**“).

Die Liste der annehmbaren Wertpapiere, die von einem Zeichner als Bestandteil eines ausgehandelten Portfolio-Korbes geliefert werden können, wird jedem Anleger, der auf diese Weise zeichnen möchte, am betreffenden Handelstag übermittelt.

Der genaue Wert der Barkomponente bei einem festen Portfolio-Korb und einem ausgehandelten Portfolio-Korb wird nach Berechnung des Nettoinventarwerts des betreffenden Fonds für den jeweiligen Handelstag auf Basis der bei der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil verwendeten Preise ermittelt und entspricht der Differenz zwischen dem Wert der auszugeben Anteile und dem Wert des festen Portfolio-Korbes bzw. ausgehandelten Portfolio-Korbes unter Anwendung derselben Bewertungsmethode, die für die Ermittlung des Nettoinventarwerts je Anteil angewandt wird.

Die Abrechnung/Lieferung von Zeichnungen erfolgt spätestens fünf (5) Geschäftstage nach dem jeweiligen Handelstag.

Die Verwaltungsgesellschaft ist berechtigt, die vorgeschlagenen Wertpapiere abzulehnen, und hat eine Frist von sieben (7) Geschäftstagen ab dem Tag ihrer Hinterlegung, um seine Entscheidung mitzuteilen. Wird der feste Portfolio-Korb bzw. der ausgehandelte Portfolio-Korb nicht in genau der Form, die mit dem Anlageverwalter vereinbart wurde, zusammen mit der jeweiligen Barkomponente bis zu dem im maßgeblichen Nachtrag

festgelegten Zeitpunkt an die Gesellschaft geliefert, behält sich der Verwaltungsrat das Recht vor, die vorläufige Zuteilung der Anteile zu stornieren und kann versuchen, der Gesellschaft jeweils für die Zuteilung angefallene Kreditkosten zurückzuerlangen. Bei allen Zeichnungen in Sachwerten müssen (i) die an den betreffenden Fonds zu übertragenden Vermögenswerte so beschaffen sein, dass sie als Anlagen des betreffenden Fonds gemäß dessen Anlageziel, seiner Anlagepolitik und seinen Anlagebeschränkungen qualifiziert sind; (ii) müssen die Vermögenswerte bei der Verwahrstelle hinterlegt sein bzw. Vorkehrungen getroffen werden, dass die Vermögenswerte bei der Verwahrstelle hinterlegt werden; (iii) darf die Anzahl der ausgegebenen Anteile nicht über die Anzahl hinausgehen, die für einen entsprechenden Barbetrag ausgegeben worden wäre; und (iv) muss sich die Verwahrstelle vergewissert haben, dass ein wesentlicher Schaden für die bestehenden Anteilinhaber unwahrscheinlich ist.

ETF-Anteilszeichnungen sind unwiderruflich, und die oben beschriebenen Bestimmungen können auf Zeichnungsanträge angewandt werden, die nicht in der oben beschriebenen Art und Weise vollständig beglichen werden.

Zeichnung von Nicht-ETF-Anteilen gegen Sachwerte. Jeder Fonds kann es Anlegern ermöglichen an jedem Handelstag Nicht-ETF-Anteile gegen Sachwerte zu zeichnen, sofern dies im maßgeblichen Nachtrag festgelegt ist (und nicht während Zeiten, während denen die Berechnung des Nettoinventarwerts pro Anteil ausgesetzt ist). „In Sachwerten“ bedeutet in diesem Kontext, dass anstelle der Entgegennahme von Barmitteln für eine Zeichnung die Gesellschaft Wertpapiere (oder überwiegend Wertpapiere) und eine Barkomponente entgegennimmt.

Zeichnungen für Nicht-ETF-Anteile, die beim Administrator vor dem im maßgeblichen Nachtrag festgelegten Orderannahmeschluss an einem Handelstag eingehen, werden an diesem Handelstag angenommen und gemäß den Bestimmungen des maßgeblichen Nachtrags bearbeitet, unter dem Vorbehalt, dass der Verwaltungsrat in außergewöhnlichen Umständen beschließen kann, Zeichnungen nach dem jeweiligen Orderannahmeschluss anzunehmen, wenn sie vor dem maßgeblichen Bewertungszeitpunkt eingegangen sind.

Zeichnungen von Nicht-ETF-Anteilen gegen Sachwerte können von Anlegern nach Maßgabe des Verwaltungsrats in Form eines festen Portfoliokorbs, wie vorstehend unter „Zeichnung von ETF-Anteilen gegen Sachwerte“ beschrieben, angenommen werden. Die Zusammensetzung des von einem Anleger zu liefernden festen Portfolio-Korbes und eines geschätzten Barbetrages werden handelstäglich auf der Website veröffentlicht. Zeichnungen von Nicht-ETF-Anteilen gegen Sachwerte werden im Allgemeinen nicht in Form eines ausgehandelten Portfolio-Korbes akzeptiert. Der genaue Wert der Barkomponente im Fall eines festen Portfolio-Korbes wird nach Berechnung des Nettoinventarwerts des entsprechenden Fonds für den entsprechenden Handelstag ermittelt. Der Wert wird durch Ermittlung der Kursbasis, die zur Berechnung des Nettoinventarwerts pro Anteil angesetzt wird, festgesetzt und entspricht der Differenz zwischen dem Wert der auszugebenden Anteile und dem Wert des festen Portfolio-Korbes. Dabei wird die gleiche Bewertungsmethode

verwendet, wie auch zur Ermittlung des Nettoinventarwerts pro Anteil.

Die Abrechnung/Lieferung von Zeichnungen erfolgt spätestens fünf (5) Geschäftstage nach dem jeweiligen Handelstag.

Wird der feste Portfolio-Korb nicht in genau der Form, die mit dem Anlageverwalter vereinbart wurde, zusammen mit der jeweiligen Barkomponente bis zu dem im maßgeblichen Nachtrag festgelegten Zeitpunkt an die Gesellschaft geliefert, behält sich der Verwaltungsrat das Recht vor, die vorläufige Zuteilung der Anteile zu stornieren und kann versuchen, der Gesellschaft jeweils für die Zuteilung angefallene Kreditkosten zurückzuerlangen. Bei allen Zeichnungen in Sachwerten müssen (i) die an den betreffenden Fonds zu übertragenden Vermögenswerte so beschaffen sein, dass sie als Anlagen des betreffenden Fonds gemäß dessen Anlageziel, seiner Anlagepolitik und seinen Anlagebeschränkungen qualifiziert sind; (ii) müssen die Vermögenswerte bei der Verwahrstelle hinterlegt sein bzw. Vorkehrungen getroffen werden, dass die Vermögenswerte bei der Verwahrstelle hinterlegt werden; (iii) darf die Anzahl der ausgegebenen Anteile nicht über die Anzahl hinausgehen, die für einen entsprechenden Barbetrag ausgegeben worden wäre; und (iv) muss sich die Verwahrstelle vergewissert haben, dass ein wesentlicher Schaden für die bestehenden Anteilinhaber unwahrscheinlich ist.

Nicht-ETF-Anteilszeichnungen sind unwiderruflich, und die oben beschriebenen Bestimmungen können auf Zeichnungsanträge angewandt werden, die nicht in der oben beschriebenen Art und Weise vollständig beglichen werden.

Abgaben und Gebühren für Zeichnungen in Sachwerten. Der Verwaltungsrat kann nach seinem alleinigen Ermessen für jede Zeichnung angemessene Abgaben und Gebühren vorsehen.

Registrierung von Anteilen.

Alle Anteile werden in registrierter Form ausgegeben. Anleger, die Anteile gezeichnet haben, erhalten eine schriftliche Handelsbestätigung. Anteile können nur als voll eingezahlte, ganze Anteile ausgegeben werden.

Anteile werden in stückeloser, nicht verbriefter Form über die internationalen Zentralverwahrer (International Central Securities Depositories) ausgegeben, vorbehaltlich der Ausstellung eines Sammelzertifikats, wenn ein solches von einem internationalen Zentralverwahrer, bei dem Anteile gehalten werden, verlangt wird. Die internationalen Zentralverwahrer für die Fonds sind derzeit Euroclear Bank S.A./N.V. und Clearstream Banking, Société Anonyme, Luxembourg sowie ggf. deren Nachfolger. Die Gesellschaft stellt keine einzelnen Anteilszertifikate aus. Das Sammelzertifikat wird bei der jeweiligen gemeinsamen Depotstelle hinterlegt (die Stelle, die durch den betreffenden internationalen Zentralverwahrer beauftragt wird, das Sammelzertifikat zu halten) und auf den Namen der relevanten gemeinsamen Depotstelle (oder ihres Nominee) registriert. Die gemeinsame Depotstelle (bzw. ihr Nominee) wird im Anteilinhaberregister als Inhaber der Anteile geführt. Infolgedessen werden die Käufer von Anteilen der Fonds nicht im Anteilinhaberregister der Gesellschaft als

Anteilinhaber registriert, haben aber ein wirtschaftliches Eigentum an diesen Anteilen, und die Rechte dieser Anleger werden in ihrem Vertrag mit ihrem Nominee, Makler oder Zentralverwahrer geregelt.

Die Gesellschaft oder ihr ordnungsgemäß bevollmächtigter Vertreter können Anleger jederzeit auffordern, ihnen Informationen vorzulegen über: (a) die Eigenschaft, in der sie eine Beteiligung an Anteilen halten; (b) die Identität anderer Personen, die an diesen Anteilen aktuell beteiligt sind oder zu einem früheren Zeitpunkt beteiligt waren; (c) die Art solcher Beteiligungen; und (d) sonstige Angelegenheiten, wenn die Offenlegung dieser Angelegenheiten erforderlich ist, damit die Gesellschaft anwendbare Gesetze oder die Bestimmungen ihrer Gründungsdokumente einhalten kann.

Die Gesellschaft oder ihr ordnungsgemäß bevollmächtigter Vertreter können jederzeit den zuständigen internationalen Zentralverwahrer (ICSD) auffordern, der Gesellschaft die folgenden Details zu übermitteln: ISIN, Name des ICSD-Teilnehmers, Art des ICSD-Teilnehmers – z. B. Fonds/Bank/natürliche Person –, Sitz des ICSD-Teilnehmers, Anzahl der ETF des Teilnehmers bei Euroclear bzw. Clearstream, der Beteiligungen an Anteilen hält, sowie die Anzahl der Anteile, die jeder dieser Teilnehmer hält.

Euroclear and Clearstream

Teilnehmer, die Inhaber von Beteiligungen an Anteilen sind, oder Intermediäre, die im Auftrag solcher Kontoinhaber handeln, werden solche Informationen auf Aufforderung des ICSD oder seines ordnungsgemäß bevollmächtigten Vertreters übermitteln und sind nach den jeweiligen Regeln und Verfahren von Euroclear und Clearstream autorisiert, diese Informationen über die Beteiligung an Anteilen gegenüber der Gesellschaft oder ihrem ordnungsgemäß bevollmächtigten Vertreter offenzulegen.

Anleger können aufgefordert werden, unverzüglich die von der Gesellschaft oder ihrem ordnungsgemäß bevollmächtigten Vertreter benötigten und verlangten Informationen vorzulegen, und erklären sich damit einverstanden, dass der zuständige internationale Zentralverwahrer der Gesellschaft auf Anfrage die Identität des Teilnehmers oder Anlegers nennt.

Rücknahme von Anteilen. Die nachfolgenden Bestimmungen gelten nur für Rücknahmen von ETF- und Nicht-ETF-Anteilen durch die Gesellschaft von Primärmarktanlegern wie beispielsweise autorisierten Teilnehmern im Zusammenhang mit ETF-Anteilen und nicht für Veräußerungen von ETF-Anteilen in Sekundärmärkten. Auf dem Sekundärmarkt erworbene ETF-Anteile können in der Regel nicht direkt an die Gesellschaft zurückverkauft werden. Anleger müssen Anteile auf einem Sekundärmarkt mit der Unterstützung eines Intermediärs (z. B. ein Makler) kaufen bzw. verkaufen, und dabei können ihnen Gebühren entstehen. Ferner zahlen Anleger beim Kauf von Anteilen möglicherweise mehr als den aktuellen Nettoinventarwert und erhalten weniger als den aktuellen Nettoinventarwert beim Verkauf derselben. Unter außergewöhnlichen Umständen sind Investoren, die ETF-Anteile am Sekundärmarkt erworben haben, jedoch möglicherweise berechtigt, ihre Anteile wie im nachfolgenden Abschnitt „**Sekundärmarkt - Käufe und Verkäufe am**

Sekundärmarkt“ beschrieben, zurückzugeben.

Antrag auf Rücknahme. Anteilinhaber können an jedem Handelstag die Gesellschaft auffordern, ihre Anteile gemäß den nachfolgend beschriebenen Rücknahmeverfahren und den Bestimmungen des maßgeblichen Nachtrags zurückzunehmen. Die Verwaltungsgesellschaft kann in außergewöhnlichen Umständen beschließen, Rücknahmeanträge nach dem jeweiligen Orderannahmeschluss entgegenzunehmen, vorausgesetzt, sie gehen vor dem betreffenden Bewertungszeitpunkt ein. Ein ordnungsgemäß ausgefüllter Rücknahmeantrag muss per Fax oder, falls mit dem Administrator vereinbart, per E-Mail vor dem im maßgeblichen Nachtrag festgelegten Orderannahmeschluss am jeweiligen Handelstag beim Administrator eingehen, wobei im Falle eines Eingangs per Fax die Zahlung von Rücknahmeerlösen nur auf das bei der Gesellschaft verzeichnete Konto erfolgen kann. Der Verwaltungsrat kann in seinem alleinigen Ermessen einen Antrag auf Rücknahme von Anteilen ganz oder teilweise ablehnen, wenn der Verwaltungsrat oder dessen ordnungsgemäß bevollmächtigte Vertreter Grund zur Annahme haben, dass der Antrag in betrügerischer Absicht gestellt wurde.

Mindestrücknahmebetrag. Anteilinhaber, die Anteile zurückgeben möchten, können Anteile nur in einem Wert zurückgeben, der mindestens dem Mindestrücknahmebetrag entspricht. Der Verwaltungsrat nach seinem alleinigen Ermessen oder ordnungsgemäß bevollmächtigte Vertreter können auf den Mindestrücknahmebetrag verzichten. Der Mindestrücknahmebetrag für die einzelnen Fonds ist in den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer festgelegt.

Rücknahmen gegen Barzahlung. Anteilinhaber können die Rücknahme von Anteilen an jedem Handelstag zu dem am jeweiligen Handelstag geltenden Nettoinventarwert je Anteil beantragen. Der Administrator oder die Verwaltungsgesellschaft (oder deren ordnungsgemäß bevollmächtigte Vertreter) können die Bearbeitung eines Rücknahmeantrags solange verweigern, bis die erforderlichen Informationen vorliegen. Änderungen an den Registrierungsangaben und den Zahlungsinstruktionen eines Anteilinhabers werden erst bei Eingang der Originaldokumente beim Administrator wirksam. Für sämtliche Rücknahmen gegen Barzahlung wird ein angemessener Betrag für Abgaben und Gebühren erhoben. Die Zahlungen für zurückgenommene Anteile erfolgen spätestens zehn (10) Geschäftstage nach dem jeweiligen Orderannahmeschluss. Rücknahmeerlöse in der Basiswährung der Klasse werden per Überweisung auf ein geeignetes Bankkonto, das der zurückgebende Anteilinhaber angegeben hat, ausgezahlt. Die Kosten für die Überweisung der Rücknahmeerlöse werden von diesen Erlösen abgezogen. Zahlungen werden nur auf ein auf den Namen des registrierten Anteilinhabers lautendes Konto geleistet. Die Anteile werden zum Nettoinventarwert je Anteil des Handelstages, an dem die Rücknahme durchgeführt wird, zurückgenommen.

Rücknahme von Anteilen gegen Sachwerte. Jeder Fonds bietet Anlegern die Möglichkeit, an jedem Handelstag Anteile gegen Sachwerte zurückzugeben (sofern im entsprechenden Nachtrag nichts anderes festgelegt ist).

„Gegen Sachwerte“ bedeutet in diesem Kontext, dass mit Zustimmung des Anteilinhabers statt der Lieferung des Barerlöses für eine Rückgabe die Gesellschaft Wertpapiere oder eine Kombination aus Zahlungsmitteln und Wertpapieren liefert, wobei die Zuteilung der Vermögenswerte der Genehmigung durch die Verwahrstelle bedarf. Rücknahmeanträge müssen vor dem im maßgeblichen Nachtrag festgelegten Orderannahmeschluss am betreffenden Handelstag beim Administrator eingehen. Die Zusammensetzung des von der Gesellschaft zu liefernden Wertpapierkorbes und eines geschätzten Barbetrages werden handelstäglich auf der Website veröffentlicht. Der genaue Wert der Barkomponente wird nach Berechnung des Nettoinventarwerts am jeweiligen Handelstag auf Basis der bei der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil verwendeten Preise ermittelt und entspricht der Differenz zwischen dem Wert der zurückzunehmenden Anteile und dem Wert des Wertpapierkorbes zu den bei der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil am selben Datum angewandten Preisen. Für sämtliche Rücknahmen gegen Sachwerte wird ein angemessener Betrag für Abgaben und Gebühren erhoben.

Wenn ein Anteilinhaber die Rücknahme einer Anzahl von Anteilen eines Fonds verlangt, die 5 % des Nettoinventarwerts oder mehr ausmachen, kann die Verwaltungsgesellschaft in ihrem alleinigen Ermessen beschließen, eine Rücknahme gegen Sachwerte anzubieten. Die zu übertragenden Vermögenswerte werden nach dem Ermessen der Verwaltungsgesellschaft, vorbehaltlich der Genehmigung der Verwahrstelle, ausgewählt und zu dem Wert angesetzt, der bei der Ermittlung des Rücknahmepreises der zurückzunehmenden Anteile angesetzt wurde. In diesem Fall verkauft die Verwaltungsgesellschaft, falls gewünscht, die Vermögenswerte im Auftrag und auf Kosten des Anteilinhabers und zahlt dem Anteilinhaber das Geld aus. Solche Ausschüttungen werden die Interessen der übrigen Anteilinhaber nicht wesentlich beeinträchtigen. Die Kosten einer solchen Veräußerung sind vom zurückgebenden Anteilinhaber zu tragen.

Rücknahmeerlöse. Rücknahmeerlöse (in Sachwerten und/oder in bar) werden erst freigegeben, wenn der Administrator das Antragsformular im Original sowie alle angeforderten Dokumente zur Geldwäscheprüfung erhalten hat. Werden Anteile in stückeloser Form in einem oder mehreren anerkannten Clearing- und Abrechnungssystemen ausgegeben, kann auch die Rücknahme dieser Anteile nur durch Rücklieferung dieser Anteile über dieses anerkannte Clearing- und Abrechnungssystem erfolgen. Rücknahmeanweisungen, die nach dem jeweiligen Orderannahmeschluss eingehen, werden zurückgehalten und am folgenden Handelstag bearbeitet, sofern der Verwaltungsrat (oder seine ordnungsgemäß bevollmächtigte Vertreter) nichts anderes beschließt. Rücknahmeanweisungen sind per Fax (oder E-Mail, falls mit dem Administrator vereinbart) an den Administrator zu senden. Anteilinhaber sind nicht berechtigt, Rücknahmeanträge zurückzuziehen, sofern mit dem Verwaltungsrat in Absprache mit dem Administrator nichts anderes vereinbart wird.

Rücknahmebeschränkungen. Wenn für Anteile eines bestimmten Fonds an einem Handelstag

Rücknahmeanträge für insgesamt 10 % oder mehr der an diesem Handelstag ausgegebenen Anteile dieses Fonds eingehen, ist die Verwaltungsgesellschaft berechtigt, nach ihrem alleinigen Ermessen die Rücknahme der Anzahl von Anteilen des Fonds, für den Rücknahmeanträge eingegangen sind, die über 10 % der Anteile des Fonds hinausgehen, zu verweigern. Lehnt die Verwaltungsgesellschaft die Rücknahme von Anteilen aus diesem Grund ab, werden die Rücknahmeanträge an diesem Datum anteilig gekürzt, und die Anteile, auf die sich die jeweiligen Anträge beziehen, und die nicht zurückgenommen werden, werden an jedem folgenden Handelstag (allerdings an diesem folgenden Handelstag nicht vorrangig) zurückgenommen, bis alle Anteile des Fonds, auf die sich der ursprüngliche Antrag bezogen hat, zurückgenommen sind. Dabei ist die Gesellschaft nicht verpflichtet, an einem Handelstag mehr als 10 % der Anzahl von in Umlauf befindlichen Anteilen eines bestimmten Fonds zurückzunehmen.

Umtausch. Eine Übertragung von einem Fonds in einen anderen erfolgt durch Rückgabe der Anteile des ursprünglichen Fonds und Zeichnung von Anteilen des neuen Fonds. Auf dieser Basis und sofern im maßgeblichen Nachtrag nichts anderes angegeben ist, sind die Anteilinhaber an jedem Handelstag berechtigt, einen Teil oder alle ihre Anteile jeder Klasse eines Fonds in Anteile jeder Klasse eines anderen Fonds umzutauschen, sofern sie die normalen Kriterien für Zeichnungen in diesen Fonds erfüllen, es sei denn, der Handel mit den betreffenden Anteilen wurde unter den in diesem Prospekt beschriebenen Umständen vorübergehend ausgesetzt. Bei einem Umtausch wird ein angemessener Betrag für Abgaben und Gebühren erhoben.

Zwangsrücknahme von Anteilen. Ein Fonds wird für einen unbegrenzten Zeitraum aufgelegt und kann unbegrenzte Vermögenswerte haben. Ein Fonds kann jedoch (ohne dazu verpflichtet zu sein) alle ausgegebenen Anteile einer Serie oder Klasse zurücknehmen, wenn:

- a) die Anteilinhaber des betreffenden Fonds auf einer Hauptversammlung der Inhaber der Anteile dieser Klasse diese Rücknahme per Sonderbeschluss beschließen;
- b) die Rücknahme der Anteile dieser Klasse durch schriftlichen, von allen Inhabern der Anteile dieser Klasse des betreffenden Fonds unterzeichneten Beschluss genehmigt wird;
- c) der Verwaltungsrat es für sinnvoll erachtet, weil der betreffende Fonds in irgendeiner Weise von politischen, wirtschaftlichen, steuerlichen oder aufsichtsrechtlichen Veränderungen betroffen ist;
- d) der Nettoinventarwert des betreffenden Fonds unter 50.000.000 USD bzw. den Gegenwert der Währung, auf die die Anteile des betreffenden Fonds lauten, fällt;
- e) die Anteile des betreffenden Fonds nicht mehr an einer Wertpapierbörse notiert sind; oder
- f) der Verwaltungsrat es aus anderen Gründen für sinnvoll erachtet. In diesem Fall werden die

Anteilinhaber mit einer Frist von dreißig (30) Tagen informiert.

Wenn die Verwahrstelle ihre Absicht mitgeteilt hat, nicht mehr für die Gesellschaft tätig zu sein, und nicht innerhalb von neunzig (90) Tagen ab dieser Mitteilung eine neue, für die Gesellschaft und die Zentralbank annehmbare Verwahrstelle bestellt wird, beantragt die Gesellschaft bei der Zentralbank den Widerruf ihrer Zulassung und nimmt sämtliche ausgegebenen Anteile aller Serien oder Klassen zurück.

In jedem dieser Fälle werden die Anteile einer Klasse nach Benachrichtigung aller Inhaber dieser Anteile mit einer Frist von mindestens einem (1) und höchstens drei (3) Monaten zurückgenommen. Die Anteile werden zum Nettoinventarwert je Anteil am betreffenden Handelstag, abzüglich der Beträge, die der Verwaltungsrat nach seinem Ermessen (oder seine ordnungsgemäß bevollmächtigten Vertreter) von Zeit zu Zeit als angemessene Beträge für die geschätzten Realisierungskosten der Vermögenswerte der Gesellschaft festlegt, zurückgenommen.

Angewiesener Handel. autorisierte Teilnehmer in Primärmärkten können um die Durchführung einer Transaktion ersuchen, so zum Beispiel (ohne Einschränkungen) den Kauf oder Verkauf von Wertpapieren in ihrem Namen, im Rahmen einer Zeichnung oder einer Rücknahme, gemäß den dafür geltenden Bedingungen. Diese Bedingungen schreiben unter anderem (ohne Einschränkungen) die Verwendung eines bestimmten Maklers oder Marktes vor oder andere Bedingungen, die nicht den Standardbedingungen, zu denen der Anlageverwalter im Allgemeinen Transaktionen für die Gesellschaft durchführt, entsprechen. Dabei muss er seiner Verpflichtung die beste Durchführung für die Gesellschaft herbeizuführen nachkommen. Anleger, die ein Geschäft zu diesen speziellen Bedingungen anweisen möchten, sollten den Anlageverwalter rechtzeitig vor einem geplanten Handelsdatum kontaktieren, um die Bedingungen dieses Geschäfts vorzuschlagen, vorausgesetzt, dass weder die Gesellschaft noch der Anlageverwalter verpflichtet sind, derartigen Vorschlägen zuzustimmen. Anleger sollten beachten, dass weder die Gesellschaft noch der Anlageverwalter oder ihre Vertreter eine Haftung für Verluste, Schäden oder Verzögerungen übernehmen, die durch die Einhaltung solcher mit einem Anleger vereinbarten Bedingungen entstehen. Anleger sollten auch die Risikohinweise unter der Überschrift „**Risiken im Zusammenhang mit angewiesenem Handel**“ im Abschnitt „**Risikoinformationen**“ lesen.

Sekundärmarkt

Sekundärmarktkäufe und Verkäufe von ETF-Anteilen. Die ETF-Anteile sind zum Sekundärhandel an jeder Wertpapierbörse notiert, und einzelne ETF-Anteile können über einen Makler/Händler an den Wertpapierbörsen gekauft und verkauft werden. Die Öffnungs- und Schließungstage der Wertpapierbörsen werden auf der Website angegeben. Kauft oder verkauft ein Anleger ETF-Anteile am Sekundärmarkt, dann bezahlt der Anleger für die ETF-Anteile den Sekundärmarktkurs. Darüber hinaus können einem Investor marktübliche Maklerprovisionen und Gebühren entstehen, und Sie müssen möglicherweise für jede Etappe einer Kauf- und Verkaufstransaktionen einen

Teil oder die gesamte Spanne zwischen dem Geld- und dem Briefkurs am Sekundärmarkt zahlen. Anleger sollten auch die Risikowarnungen mit den Überschriften „**Risiko - Kosten des Kaufs und Verkaufs von Anteilen**“ und „**Handelsrisiken**“ im Abschnitt „**Risikoinformationen**“ lesen.

Auf dem Sekundärmarkt erworbene ETF-Anteile können in der Regel nicht direkt an die Gesellschaft zurückverkauft werden. Unter außerordentlichen Umständen, wie vom Verwaltungsrat festgelegt, ob infolge von Störungen auf dem Sekundärmarkt oder anderweitig, sind Investoren, die ETF-Anteile im Sekundärmarkt erworben haben, berechtigt, bei der Gesellschaft schriftlich einen Antrag zu stellen, um die betreffenden ETF-Anteile in ihrem eigenen Namen registrieren zu lassen, um Zugang zu den im obigen Abschnitt „**Primärmarkt**“ beschriebenen Rücknahmemöglichkeiten zu erhalten. Anleger, die dies möchten, sollten sich an den Administrator wenden, um die entsprechenden Informationen zu übermitteln, einschließlich der Originaldokumente, die der Administrator anfordert, um den Anleger als Anteilinhaber zu registrieren. Eine Gebühr zu handelsüblichen Sätzen kann für diesen Vorgang erhoben werden.

Sekundärmarktpreise. Die Handelspreise der ETF-Anteile eines Fonds schwanken kontinuierlich während der Handelsstunden auf Basis von Angebot und Nachfrage, während der Nettoinventarwert je Anteil lediglich am Ende des jeweiligen Geschäftstages berechnet wird. Die Anteile werden an der Wertpapierbörse zu Preisen gehandelt, die in unterschiedlichem Grad über (d.h. mit einem Aufschlag) oder unter (d.h. mit einem Abschlag) dem Nettoinventarwert der Anteile liegen können. Die Handelskurse für ETF-Anteile eines Fonds können in Marktschwankungsphasen erheblich vom Nettoinventarwert pro Anteil abweichen und können Maklerprovisionen und/oder Transfersteuern, die für den Handel und die Abrechnung über die jeweilige Börse anfallen, unterliegen. Es kann nicht garantiert werden, dass ETF-Anteile, die an einer Börse notiert werden, auch in Zukunft dort notiert werden. Auf der Website können sich Anleger darüber informieren, an wie vielen Tagen in verschiedenen Zeiträumen der Marktpreis der ETF-Anteile eines Fonds höher war als der Nettoinventarwert je Anteil, und an wie vielen Tagen er niedriger war als der Nettoinventarwert je Anteil (Aufschlag oder Abschlag). Anleger sollten auch die Risikohinweise unter der Überschrift „**Schwankung des Nettoinventarwerts**“ im Abschnitt „**Risikoinformationen**“ lesen.

In regelmäßigen Abständen während des Tages wird ein **INAV** veröffentlicht. Das ist eine Schätzung des Nettoinventarwerts pro Anteil, der anhand von Marktdaten ermittelt wird. Der INAV basiert auf den notierten Kurswerten und den letzten Verkaufspreisen am lokalen Markt für die Wertpapiere und reflektiert möglicherweise nicht Ereignisse, die nach Marktschluss am lokalen Markt eintreten. Es können sich Auf- und Abschlüsse zwischen INAV und dem Marktkurs ergeben. Der INAV darf daher nicht als eine Aktualisierung des Nettoinventarwerts pro Anteil in Echtzeit gesehen werden. Dieser wird nur einmal am Tag berechnet. Weder die Fonds noch der Anlageverwalter oder deren Konzerngesellschaften, noch externe Berechnungsstellen, die an der Berechnung oder Veröffentlichung solcher INAVs beteiligt oder dafür verantwortlich sind, garantieren für deren Richtigkeit. Einzelheiten zum INAV für die jeweiligen Fonds

finden Sie auf der Website.

Liquiditätsrisikomanagement

Die Verwaltungsgesellschaft hat eine Politik des Liquiditätsrisikomanagements eingeführt, die es ihr ermöglicht, die Liquiditätsrisiken der Gesellschaft zu ermitteln, überwachen und steuern sowie sicherzustellen, dass das Liquiditätsprofil der Anlagen der einzelnen Fonds die Einhaltung der zugrunde liegenden Verpflichtungen jedes Fonds unterstützt. Die Politik der Verwaltungsgesellschaft zum Liquiditätsrisikomanagement berücksichtigt die Anlagestrategie, das Liquiditätsprofil, die Rücknahmepolitik und andere zugrunde liegende Verpflichtungen der Fonds. Zu den Liquiditätsmanagementsystemen und -verfahren gehören angemessene Eskalationsmaßnahmen zur Lösung erwarteter oder tatsächlicher Liquiditätsengpässe oder anderer Krisensituationen der Gesellschaft.

Zusammengefasst überwacht die Politik des Liquiditätsrisikomanagements das Profil der von der Gesellschaft und den einzelnen Fonds gehaltenen Anlagen und stellt sicher, dass diese Anlagen für die Rücknahmepolitik wie oben beschrieben geeignet sind und die Einhaltung der zugrunde liegenden Verpflichtungen jedes Fonds unterstützen. Des Weiteren beinhaltet die Politik des Liquiditätsrisikomanagements Einzelheiten in Bezug auf regelmäßige Stresstests, die vom Anlageverwalter zur Steuerung des Liquiditätsrisikos der einzelnen Fonds unter außergewöhnlichen und außerordentlichen Umständen durchgeführt werden.

Die Verwaltungsgesellschaft versucht sicherzustellen, dass die Anlagestrategie, das Liquiditätsprofil und die Rücknahmepolitik der einzelnen Fonds übereinstimmen. Die Anlagestrategie, das Liquiditätsprofil und die Rücknahmepolitik der Gesellschaft gelten als abgestimmt, wenn es Anlegern möglich ist, ihre Anlage auf eine Art und Weise zurückzugeben, die der gerechten Behandlung aller Anleger sowie der Rücknahmepolitik der Gesellschaft und ihrer Verpflichtungen entspricht. Bei der Beurteilung des Abstimmung der Anlagestrategie, des Liquiditätsprofils und der Rücknahmepolitik berücksichtigt die Verwaltungsgesellschaft die Auswirkungen, die Rücknahmen auf die zugrunde liegenden Kurse oder Spreads der einzelnen Anlage jedes Fonds haben können. Einzelheiten zu den Rechten der Anteilinhaber auf Rücknahme, u. a. Rücknahmrechte von Anteilinhabern unter normalen und außergewöhnlichen Umständen sowie bestehende Rücknahmevereinbarungen sind weiter oben in diesem Abschnitt dargelegt.

Ermittlung des Nettoinventarwerts

Die Berechnung des Nettoinventarwerts der einzelnen Fonds und des Nettoinventarwerts je Anteil wurde an die Verwaltungsstelle delegiert.

Der Nettoinventarwert eines Fonds wird berechnet, indem der Wert des Vermögens des jeweiligen Fonds ermittelt und davon die Verbindlichkeiten des Fonds abgezogen werden. Zu den Verbindlichkeiten zählen alle Kosten und Gebühren, die aus dem Vermögen des Fonds zahlbar sind und/oder aufgelaufen sind und/oder schätzungsweise zahlbar sind.

Der Nettoinventarwert je Anteil eines Fonds wird berechnet, indem der Nettoinventarwert des betreffenden Fonds durch die Gesamtanzahl der am jeweiligen Geschäftstag ausgegebenen oder als ausgegeben geltenden Anteile für diesen Fonds geteilt wird.

Der Nettoinventarwert je Anteil eines Fonds wird gemäß den in der Satzung festgelegten und nachfolgend zusammengefassten Bewertungsbestimmungen in der Basiswährung des betreffenden Fonds am jeweiligen Geschäftstag berechnet und auf vier Dezimalstellen gerundet.

Falls die Anteile eines Teilfonds in verschiedene Anteilsklassen unterteilt sind, wird der einer Klasse zurechenbare Nettoinventarwert der Gesellschaft berechnet, indem die Anzahl der in dieser Klasse ausgegebenen Anteile zum betreffenden Bewertungszeitpunkt ermittelt wird und die jeweiligen Gebühren und klassenspezifischen Auslagen dieser Klasse zugerechnet werden, wobei angemessene Anpassungen für Ausschüttungen, Zeichnungen, Rücknahmen, Gewinne und Auslagen dieser Klasse vorgenommen werden und der Nettoinventarwert der Gesellschaft entsprechend aufgeteilt wird. Der Nettoinventarwert je Anteil für eine Klasse wird berechnet, indem der Nettoinventarwert der betreffenden Klasse durch die Anzahl von ausgegebenen Anteilen der betreffenden Klasse geteilt wird. Der einer Klasse zurechenbare Nettoinventarwert der Gesellschaft und der Nettoinventarwert je Anteil für eine Klasse werden in der Währung dieser Klasse angegeben, wenn diese sich von der Basiswährung unterscheidet.

Der Nettoinventarwert je Anteil der Gesellschaft wird zum Bewertungszeitpunkt an jedem Geschäftstag berechnet.

Jeder Vermögenswert, der an einem anerkannten Markt oder gemäß dessen Regeln notiert, gelistet oder gehandelt wird, wird anhand der Indexbewertungsmethode bewertet. Dementsprechend werden diese Vermögenswerte je nach den Bedingungen des maßgeblichen Index zum (a) Geldkurs bei Börsenschluss, (b) letzten Geldkurs, (c) letztgehandelten Kurs, (d) Mittelkurs bei Börsenschluss oder (e) letzten Mittelkurs am maßgeblichen anerkannten Markt bei Geschäftsschluss an diesem anerkannten Markt an jedem Handelstag bewertet. Zu diesem Zweck holt der Administrator Kurse von unabhängigen Quellen ein, wie z. B. anerkannte Kursmakler (Pricing Services) oder Makler, die sich auf die betreffenden Märkte spezialisiert haben. Ist die Anlage üblicherweise an mehr als einem anerkannten Markt oder gemäß dessen Regeln notiert, gelistet oder gehandelt, ist der maßgebliche anerkannte Markt – je nach

Entscheidung der Verwaltungsgesellschaft – entweder (a) der Markt, der den Hauptmarkt für die Anlage darstellt, oder (b) der Markt, der gemäß Entscheidung der Verwaltungsgesellschaft die gerechtesten Kriterien für die Bewertung des Wertpapiers bietet. Falls für eine am maßgeblichen anerkannten Markt notierte, gelistete oder gehandelte Anlage zum betreffenden Zeitpunkt keine Kurse verfügbar sind oder diese nach Ansicht der Verwaltungsgesellschaft nicht repräsentativ sind, so wird diese Anlage zu dem Wert bewertet, der von einer Person, Firma oder Gesellschaft mit entsprechenden Kompetenzen nach Treu und Glauben geschätzt, die von der Verwaltungsgesellschaft zu diesem Zweck bestellt und von der Verwahrstelle für diesen Zweck genehmigt wurde. Ist die Anlage an einem anerkannten Markt notiert, gelistet oder gehandelt, jedoch außerhalb des anerkannten Marktes zu einem Auf- oder Abschlag gekauft oder gehandelt wurde, ist bei der Bewertung der Anlage die Höhe des Auf- oder Abschlags am Bewertungstag des Instrumentes zu berücksichtigen, und die Verwahrstelle muss sicherstellen, dass der Einsatz dieses Verfahrens im Zusammenhang mit der Ermittlung des wahrscheinlichen Realisationswerts des Wertpapiers gerechtfertigt ist. Weder die Verwaltungsgesellschaft noch dessen Beauftragte oder die Verwahrstelle unterliegen irgendeiner Haftung, wenn sich herausstellt, dass der Preis, der von ihnen nach vernünftigem Ermessen als (a) der Schlussgeldkurs, (b) der Schlussbriefkurs, (c) der letztgehandelte Kurs, (d) der Schlussmittelkurs oder (e) der letzte verfügbare Mittelkurs angesehen wurde, demselben nicht entsprach.

Der Wert einer Anlage, die nicht regulär an einem anerkannten Markt oder nach den Regeln eines anerkannten Marktes notiert, gelistet oder gehandelt wird, wird zu ihrem wahrscheinlichen Veräußerungswert mit Sorgfalt und in gutem Glauben von der Verwaltungsgesellschaft nach Abstimmung mit dem Administrator oder durch eine Person, Firma oder Gesellschaft mit entsprechender Kompetenz bewertet, die von der Verwaltungsgesellschaft bestellt und für diesen Zweck von der Verwahrstelle genehmigt wurde.

Barbestände oder Bareinlagen werden zu ihren Nominalwert zusammen mit ggf. aufgelaufenen Zinsen bewertet, falls nicht nach Ansicht der Verwaltungsgesellschaft (nach Abstimmung mit dem Administrator und der Verwahrstelle) eine Anpassung durchgeführt werden sollte, um deren beizulegenden Zeitwert wiederzugeben;

Derivative Instrumente, einschließlich Swaps, Zinsfutures, börsengehandelte Futures, Index-Futures und andere Finanzterminkontrakte, die an einem anerkannten Markt gehandelt werden, werden auf Grundlage des Preises bewertet, der von dem betreffenden anerkannten Markt bei Geschäftsschluss an diesem anerkannten Markt als Abrechnungspreis festgestellt wird; falls die Feststellung eines Abrechnungspreises an dem betreffenden anerkannten Markt nicht üblich ist oder ein Abrechnungspreis aus anderen Gründen nicht verfügbar ist, werden die Instrumente zu ihrem wahrscheinlichen Realisationswert bewertet, der von der Verwaltungsgesellschaft nach Treu und Glauben geschätzt und zu diesem Zweck durch die Verwahrstelle in Abstimmung mit dem Administrator genehmigt wird.

OTC-Derivate werden auf der Grundlage der Bewertung des

Kontrahenten oder einer alternativen Bewertung durch die Gesellschaft oder einen unabhängigen, von der Verwaltungsgesellschaft bestellten und für diesen Zweck von der Verwahrstelle genehmigten Kursanbieter bewertet. OTC-Derivate werden mindestens einmal täglich bewertet. Wird die Bewertung des Kontrahenten verwendet, muss sie von einer anderen Partei wöchentlich genehmigt und überprüft werden, die vom Kontrahenten unabhängig sein und von der Verwahrstelle genehmigt sein muss (dies kann die Gesellschaft oder eine dem OTC-Kontrahenten nahe stehende Person sein, vorausgesetzt, es handelt sich um eine unabhängige Geschäftseinheit innerhalb desselben Konzerns, die sich nicht auf die gleichen Preismodelle wie der Kontrahent stützt). Wenn eine andere Bewertungsmethode verwendet wird, befolgt die Gesellschaft internationale anerkannte Marktstandards (best practice) und die Prinzipien zur Bewertungen von OTC-Derivaten, die von Organisationen wie der International Organisation of Securities Commissions (IOSCO) und der Alternative Investment Management Association (AIMA) eingeführt wurden. Falls sich die Gesellschaft für die Verwendung einer alternativen Bewertungsmethode entscheidet, bedient sich die Verwaltungsgesellschaft einer kompetenten Person, die vom Verwaltungsrat bestellt und zu diesem Zweck von der Verwahrstelle genehmigt wurde, oder verwendet eine auf anderem Weg ermittelte Bewertung, vorausgesetzt, der Wert wird von der Verwahrstelle genehmigt. Sämtliche alternativen Bewertungen werden mindestens auf monatlicher Basis mit den Bewertungsergebnissen des Kontrahenten abgestimmt. Wesentliche Abweichungen von der Bewertung des Kontrahenten werden umgehend untersucht und erklärt.

Devisentermin- und Zinsswap-Kontrakte können unter Bezugnahme auf frei erhältliche Marktkurse bewertet werden, oder, wenn diese Kurse nicht verfügbar sind, gemäß den Bestimmungen in Bezug auf OTC-Derivate.

Bei der Berechnung des Nettoinventarwerts jedes Teilfonds und des Nettoinventarwerts je Anteil der einzelnen Teilfonds kann sich der Administrator auf diejenigen automatischen Pricing-Dienste nach seiner Wahl stützen, und der Administrator haftet (wenn kein Betrug, Fahrlässigkeit oder vorsätzliche Nichterfüllung gegeben ist) nicht für Verluste, welche die Gesellschaft oder Anteilinhaber aufgrund eines Fehlers in der Berechnung des Nettoinventarwerts erleiden, die auf Ungenauigkeiten in den von einem Pricing-Dienst gestellten Informationen zurückzuführen sind. Der Administrator unternimmt angemessene Anstrengungen, um vom Anlageverwalter oder einer verbundenen Person, einschließlich einer verbundenen Person, die ein Makler oder Market Maker oder sonstiger Vermittler ist, gestellte Preisinformationen zu überprüfen, in bestimmten Fällen ist es dem Administrator jedoch möglicherweise nicht möglich oder durchführbar, diese Informationen zu überprüfen, und in solchen Fällen haftet der Administrator (wenn kein Betrug, Fahrlässigkeit oder vorsätzliche Nichterfüllung gegeben ist) nicht für Verluste, welche die Gesellschaft oder Anteilinhaber aufgrund eines Fehlers in der Berechnung des Nettoinventarwerts erleiden, die auf Ungenauigkeiten in den vom Anlageverwalter oder seinen Bevollmächtigten gestellten Informationen zurückzuführen sind, vorausgesetzt, dass die Nutzung dieser Informationen unter den Umständen gerechtfertigt war.

Unter Umständen, unter denen der Administrator vom

Anlageverwalter oder dessen Beauftragten angewiesen wird, bestimmte Pricing Services, Makler, Market Maker oder andere Marktmittler in Anspruch zu nehmen, haftet der Administrator nicht für Verluste, die der Gesellschaft oder irgendeinem Anteilinhaber aufgrund von Fehlern in der Berechnung des Nettoinventarwerts des Fonds und des Nettoinventarwerts je Anteil des jeweiligen Fonds entstehen, die auf falsche Informationen von solchen Pricing Services, Maklern, Market Maker oder anderen Marktmittlern zurückzuführen sind.

Einlagenzertifikate werden unter Bezugnahme auf den zuletzt erhältlichen Verkaufspreis für Einlagenzertifikate mit ähnlicher Fälligkeit, ähnlichem Betrag und Kreditrisiko an jedem Handelstag bewertet, oder falls dieser Kurs nicht erhältlich ist, zum letzten Geldkurs oder, falls dieser Kurs nicht erhältlich oder nach Meinung der Verwaltungsgesellschaft nicht repräsentativ für den Wert dieses Einlagenzertifikates ist, zum wahrscheinlichen Veräußerungswert, der mit Sorgfalt und in gutem Glauben von einer kompetenten Person geschätzt wird, die von der Verwaltungsgesellschaft bestellt und für diesen Zweck von der Verwahrstelle genehmigt wurde. Treasury Bills und Wechsel werden unter Bezugnahme auf die am maßgeblichen Markt für diese Instrumente mit ähnlicher Fälligkeit, ähnlichem Betrag und ähnlichem Kreditrisiko bei Geschäftsschluss an diesen Märkten am maßgeblichen Handelstag geltenden Preise bewertet.

Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) werden auf Basis des letzten verfügbaren Nettoinventarwerts je Anteil, der von dem OGA veröffentlicht wird, bewertet. Wenn Anteile an solchen OGA an oder gemäß den Bestimmungen von anerkannten Märkten notiert oder gehandelt werden, werden diese Anteile gemäß den vorstehend genannten Regeln für die Bewertung von Vermögenswerten, die an oder gemäß den Bestimmungen von anerkannten Märkten notiert oder gehandelt werden, bewertet. Falls diese Preise nicht verfügbar sind, werden die Fondsanteile zu ihrem wahrscheinlichen Veräußerungswert bewertet, der mit Sorgfalt und in gutem Glauben von der Verwaltungsgesellschaft nach Abstimmung mit dem Administrator oder durch eine Person, Firma oder Gesellschaft mit entsprechender Kompetenz geschätzt wurde, die für diesen Zweck von der Verwaltungsgesellschaft bestellt und für diesen Zweck von der Verwahrstelle genehmigt wurde.

Ungeachtet der obigen Bestimmungen kann die Verwaltungsgesellschaft mit der Genehmigung der Verwahrstelle (a) die Bewertung einer börsennotierten Anlage anpassen, wenn diese Anpassung für erforderlich gehalten wird, um den beizulegenden Zeitwert unter Berücksichtigung der Währung, der Marktgängigkeit, der Handelskosten und/oder anderer, ihrer Meinung nach relevanter Faktoren zu reflektieren, oder (b) in Bezug auf einen bestimmten Vermögenswert die Nutzung einer anderen, von der Verwahrstelle genehmigten Bewertungsmethode zu erlauben, wenn sie dies für notwendig erachtet.

Bei der Ermittlung des Nettoinventarwerts je Anteil werden alle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die ursprünglich auf Fremdwährungen lauten, anhand von

Tageskursen in die Basiswährung des betreffenden Fonds umgerechnet. Falls diese Notierungen nicht erhältlich sind, wird der Wechselkurs als der wahrscheinliche Veräußerungswert festgelegt, der mit Sorgfalt und in gutem Glauben von der Verwaltungsgesellschaft geschätzt wird.

Außer die Ermittlung des Nettoinventarwerts pro Anteil wurde unter den im nachfolgenden Abschnitt „**Vorübergehende Aussetzung des Handels**“ beschriebenen Umständen für einen Fonds vorübergehend ausgesetzt, wird der Nettoinventarwert pro Anteil anschließend an den Bewertungszeitpunkt am auf den entsprechenden Handelstag folgenden Geschäftstag veröffentlicht. Nach der Berechnung am Sitz des Anlageverwalters steht der aktuelle Nettoinventarwert pro Anteil auch auf der Website zur Verfügung. Der Nettoinventarwert pro Anteil ist außerdem am Sitz des Administrators verfügbar und wird wie erforderlich vom Administrator in diversen Publikationen veröffentlicht. Weiterhin wird er gemäß den entsprechenden Vorschriften der Börse der jeweiligen Börse mitgeteilt.

Vorübergehende Aussetzung des Handels. In den folgenden Fällen kann der Verwaltungsrat die Ausgabe, die Bewertung, den Verkauf, den Kauf, die Rücknahme und den Umtausch von Anteilen eines Fonds oder die Zahlung von Rücknahmeerlösen jederzeit nach vorheriger Mitteilung an die Verwahrstelle vorübergehend aussetzen:

- a) während eines Zeitraums, in dem ein anerkannter Markt, an dem ein wesentlicher Teil der von der Gesellschaft jeweils gehaltenen Anlagen notiert, gelistet oder gehandelt wird, außer aufgrund gesetzlicher Feiertage geschlossen ist oder in dem der Handel an einem solchen anerkannten Markt eingeschränkt ist oder ausgesetzt wird;
- b) während eines Zeitraums, in dem infolge politischer, militärischer, wirtschaftlicher oder währungspolitischer Ereignisse oder anderer Umstände, die außerhalb des Einflussbereiches des Verwaltungsrats liegen und nicht von diesem zu verantworten sind, die Veräußerung oder Bewertung von jeweils von der Gesellschaft gehaltenen Anlagen nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht auf die übliche Weise und nicht ohne Beeinträchtigung der Interessen der Anteilinhaber erfolgen oder abgeschlossen werden können;
- c) während eines Ausfalls der Kommunikationseinrichtungen, die üblicherweise zur Ermittlung des Werts der jeweils von der Gesellschaft gehaltenen Anlagen eingesetzt werden, oder während eines Zeitraums, in dem aus einem anderen Grund der Wert der jeweils von der Gesellschaft gehaltenen Anlagen nach Auffassung des Verwaltungsrats nicht unverzüglich oder eindeutig bestimmt werden kann;
- d) während eines Zeitraums, in dem die Gesellschaft nicht in der Lage ist, Gelder zur Leistung von Rücknahmezahlungen zu repatriieren, oder in dem die Veräußerung von jeweils von der Gesellschaft gehaltenen Anlagen oder die Übertragung oder Zahlung von in diesem Zusammenhang benötigten

Geldern nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht zu üblichen Preisen bzw. üblichen Wechselkursen getätigt werden kann;

- e) während eines Zeitraums, in dem die Zahlung von Erlösen aus Rücknahmen aufgrund ungünstiger Marktbedingungen nach Ansicht des Verwaltungsrats nachteilige Auswirkungen auf die Gesellschaft oder die verbleibenden Anteilinhaber der Gesellschaft haben kann; und
- f) während eines Zeitraums, in dem der Verwaltungsrat entscheidet, dass dies im besten Interesse der Anteilinhaber ist.

Eine Aussetzung muss von der Gesellschaft an ihrem Sitz und in den Tageszeitungen und über die weiteren Medien bekannt gegeben werden, die der Verwaltungsrat bisweilen für diesen Zweck festlegt und sie muss der Zentralbank unmittelbar (ohne Verzögerung) und den Anteilinhabern mitgeteilt werden. Die Anträge von Anteilinhabern, die die Ausgabe oder Rücknahme von Anteilen einer Serie oder Klasse in beantragt haben, werden am ersten Handelstag nach Beendigung der Aussetzung bearbeitet, es sei denn, die Zeichnungs- bzw. Rücknahmeanträge wurden vor Beendigung der Aussetzung zurückgezogen. Soweit möglich werden alle angemessenen Maßnahmen ergriffen, um Aussetzungszeiträume schnellstmöglich zu beenden.

Ausschüttungen Dividenden und Veräußerungsgewinne.

Die Anteilinhaber jedes Fonds haben Anspruch auf ihren Anteil an den Erträgen des Fonds und den realisierten Nettogewinnen aus seinen Anlagen. Jeder Fonds erzielt in der Regel Erträge in Form von Dividenden aus Aktien, Zinsen aus Schuldtiteln und gegebenenfalls Erträge aus der Wertpapierleihe. Jeder Fonds realisiert Veräußerungsgewinne oder -verluste, wenn er Wertpapiere verkauft. In Abhängigkeit vom zugrunde liegenden Markt kann der Fonds im Falle von Veräußerungsgewinnen auf diesem zugrunde liegenden Markt einer Kapitalertragsteuer unterliegen.

Jeder Fonds kann thesaurierende Anteile haben, bei denen sich Erträge und Veräußerungsgewinne im Nettoinventarwert je Anteil niederschlagen, oder ausschüttende Anteile, bei denen nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft regelmäßig eine beliebige Kombination aus Erträgen und Kapitalgewinnen an die Anteilinhaber ausgeschüttet wird, oder beides. Die Ausschüttungspolitik für Anteile eines Fonds ist im maßgeblichen Nachtrag festgelegt. Die Ausschüttungspolitik eines Fonds oder einer Anteilsklasse kann von der Verwaltungsgesellschaft nach angemessener Mitteilung an die Anteilinhaber dieses Fonds bzw. dieser Anteilsklasse geändert werden, und in diesen Fällen wird die Ausschüttungspolitik in einem aktualisierten Prospekt und/oder Nachtrag offen gelegt.

Dividenden werden in der Basiswährung der jeweiligen Anteilsklasse erklärt. Eine Dividende, die für einen Anteil an einem Fonds ausgeschüttet wurde und nicht innerhalb von sechs Jahren ab ihrer Erklärung eingefordert wird, ist verwirkt und wird dann zum Nutzen des jeweiligen Fonds einbehalten. Es werden auf Dividenden keine Zinsen bezahlt.

Gebühren und Kosten

Alle Gebühren und Kosten, die für einen Fonds zahlbar sind, werden als eine einzige Gebühr gezahlt. Diese wird als „Gesamtkostenquote“ oder „TER“ bezeichnet. Die TER enthält, wie nachfolgend dargelegt, keine außergewöhnlichen Kosten und keine bestimmten laufenden Kosten und Auslagen.

Nach Abzug und Zahlung der Verwaltungsratsbezüge und Kosten des Verwaltungsrats und der Gebühren und Kosten der Wirtschaftsprüfer (die in der TER enthalten sind) wird der Rest der TER an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt, und der Verwaltungsgesellschaft obliegt dann die Zahlung aller Betriebskosten der Gesellschaft. Hierzu zählen insbesondere Gebühren und Kosten der Verwahrstelle, des Administrators und des Gesellschaftssekretärs. Die Verwaltungsgesellschaft kann einen Teil oder alle seine Gebühren an Personen zahlen, die in die Gesellschaft investieren oder für die Gesellschaft oder einen Fonds Dienstleistungen erbringen.

Die Verwaltungsgesellschaft ist auch für die Zahlung der folgenden Gebühren und Kosten verantwortlich:

- die Kosten der Notierung und der Aufrechterhaltung einer Notierung der Anteile an einer Wertpapierbörse;
- die Kosten der Einberufung und Abhaltung von Verwaltungsrats- und Anteilinhaberversammlungen;
- Honorare und Gebühren für juristische und andere Beratungsdienstleistungen;
- die Kosten und Aufwendungen für die Erstellung, den Druck und die Verteilung der Prospekte, Nachträge, Jahres- und Halbjahresberichte und sonstigen Dokumente für bestehende und potenzielle Anteilinhaber;
- die Kosten und Aufwendungen, die sich aus Lizenzgebühren oder sonstigen an einen Indexanbieter und andere Lizenzgeber für Rechte an geistigem Eigentum, Marken oder Dienstleistungsmarken, die die Gesellschaft verwendet, ergeben;
- die Kosten und Aufwendungen eines vom Anlageverwalter bestellten Anlageberaters;
- sämtliche Gründungskosten der Gesellschaft und der Fonds, die anderweitig nicht zuvor genannt wurden; und
- sonstige von Zeit zu Zeit entstehende Kosten und Aufwendungen (einmalige und außerordentliche Kosten und Aufwendungen ausgenommen), die vom Verwaltungsrat als notwendig oder angemessen für den fortdauernden Geschäftsbetrieb der Gesellschaft oder eines Teilfonds genehmigt wurden.

Die Gesamtkostenquote (TER) enthält keine außerordentlichen Kosten und keine bestimmten Kosten und Gebühren (insbesondere keine Transaktionskosten, Stempelsteuern oder sonstige Steuern auf die Anlagen der Gesellschaft, einschließlich Abgaben und Gebühren für die Neuausrichtung der Portfolios, Quellensteuern, im Zusammenhang mit den Anlagen der Gesellschaft entstandene Provisionen und Maklergebühren, Zinsen auf Darlehen und Bankgebühren, die bei der Aushandlung, Ausführung oder Abwandlung der Bedingungen dieser Darlehen entstehen, von Intermediären im Zusammenhang mit einer Anlage in den Fonds berechnete Provisionen sowie etwaige außerordentliche oder einmalige Kosten und Gebühren, die von Zeit zu Zeit anfallen können, z. B. aufgrund wesentlicher Rechtsstreitigkeiten in Bezug auf die Gesellschaft, die allesamt gesondert aus den Vermögenswerten des betreffenden Fonds beglichen werden). Die Gesamtkostenquote (TER) schließt zudem eingebettete Kosten aus, die gegebenenfalls zusätzlich zur TER aus dem Vermögen des jeweiligen Fonds anfallen.

Die TER wird täglich anhand des Nettoinventarwerts der einzelnen Fonds ermittelt und monatlich nachträglich gezahlt. Die TER jedes Fonds der Gesellschaft ist im maßgeblichen Nachtrag aufgeführt. Übersteigen die Aufwendungen eines Fonds die oben angegebene TER in Zusammenhang mit dem Betrieb der Fonds, dann begleicht

der Anlageverwalter den Fehlbetrag aus seinem eigenen Vermögen.

Vergütungspolitik und -praktiken

Die Verwaltungsgesellschaft unterliegt den Vergütungsvorschriften, -verfahren und -praktiken (zusammen die „**Vergütungspolitik**“), die der OGAW-Richtlinie entsprechen. Die Vergütungspolitik ist mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar und diesem förderlich. Sie soll nicht zur Übernahme von Risiken ermutigen, die mit dem Risikoprofil der Fonds nicht vereinbar sind. Die Vergütungspolitik steht im Einklang mit Geschäftsstrategie, Zielen, Werten und Interessen der Gesellschaft und der Fonds. Sie umfasst Maßnahmen zur Vermeidung von Interessenkonflikten. Die Vergütungspolitik gilt für Mitarbeiter, deren berufliche Tätigkeit sich wesentlich auf das Risikoprofil der Gesellschaft oder der Fonds auswirkt, und stellt sicher, dass kein Mitarbeiter an der Festlegung oder Genehmigung seiner eigenen Vergütung beteiligt ist. Die Vergütungspolitik wird mindestens jährlich überprüft. Einzelheiten der aktuellen Vergütungspolitik sind im Jahresbericht und im geprüften Jahresabschluss unter Anhang I Vergütungspolitik (ungeprüft) enthalten. Diese Dokumente sind über die Website zugänglich. Die Vergütungspolitik steht ferner zur Einsichtnahme zur Verfügung und ist kostenlos am eingetragenen Sitz der Gesellschaft erhältlich.

Steuerinformationen

Im Folgenden sind bestimmte steuerliche Auswirkungen des Kaufs, des Besitzes und der Veräußerung von Anteilen in Irland zusammengefasst. Diese Zusammenfassung stellt keine umfassende Beschreibung aller möglicherweise relevanten Erwägungen hinsichtlich irischer Steuern dar. Die Zusammenfassung bezieht sich nur auf die Lage von Personen, die uneingeschränkte wirtschaftliche Eigentümer der Anteile sind (keine Wertpapierhändler). Die Zusammenfassung basiert auf den irischen Steuergesetzen und der Praxis der irischen Steuerbehörde (Irish Revenue Commissioners), die bei Herausgabe dieses Prospekts in Kraft sind (und steht unter dem Vorbehalt zukünftiger oder rückwirkender Änderungen). Potenzielle Anleger von Anteilen sollten bezüglich der Auswirkungen auf die irische oder sonstige Besteuerung des Kaufs, Besitzes und der Veräußerung von Anteilen ihre eigenen Berater konsultieren.

Besteuerung der Gesellschaft

Die Gesellschaft beabsichtigt, ihre Geschäfte so zu führen, dass sie steuerlich in Irland ansässig ist. Auf dieser Basis der steuerlichen Ansässigkeit in Irland ist die Gesellschaft nach irischem Steuerrecht als „Investmentgesellschaft“ (investment undertaking) qualifiziert und folglich von der irischen Körperschaftsteuer auf ihre Erträge und Gewinne befreit.

Sofern die Anteile weiter in einem anerkannten Clearing-System (einschließlich CREST, Euroclear und Clearstream Banking) gehalten werden, ist die Gesellschaft in Bezug auf diese Anteile nicht verpflichtet, irische Steuern an die irische Steuerbehörde abzuführen. Werden jedoch die Anteile nicht mehr in einem anerkannten Clearing-System gehalten, wäre die Gesellschaft unter bestimmten Umständen verpflichtet, irische Steuern an die irische Steuerbehörde abzuführen.

Besteuerung von nicht in Irland gebietsansässigen Anteilhabern

Anteilhaber, die nicht im Sinne des irischen Steuerrechts in Irland ansässig (oder gewöhnlich ansässig) sind, unterliegen mit ihren Anteilen nicht der irischen Steuer auf Erträge oder Veräußerungsgewinne.

Wenn ein Anteilhaber eine Gesellschaft ist, die Anteile über eine irische Niederlassung oder Vertretung hält, kann der Anteilhaber der irischen Körperschaftsteuer (auf Selbstveranlagungsbasis) für die Anteile unterliegen.

Eignung für den Plan d'Epargne en Actions („PEA“) – Frankreich

Um zur Aufnahme in den französischen Tax-Wrapper PEA geeignet zu sein, müssen Fonds mindestens 75 % ihres Vermögens in PEA-geeignete Aktien gemäß Definition nach geltenden französischen Gesetzen und Vorschriften investieren. Der maßgebliche Nachtrag gibt an, ob ein Fonds zum Ausgabezeitpunkt des maßgeblichen Nachtrags PEA-geeignet ist. Sollte der Verwaltungsrat der Meinung sein, dass ein Fonds nicht mehr PEA-geeignet ist (z. B. bei indexnachbildenden Fonds, da die Indexkomponenten nicht mehr den PEA-Kriterien entsprechen), wird er dies den Anteilhabern mitteilen.

Besteuerung irischer Anteilhaber

Anteilhaber, die im Sinne des irischen Steuerrechts in Irland ansässig (oder gewöhnlich ansässig) sind, sind verpflichtet, irische Steuern, die auf Ausschüttungen, Rücknahmen und Veräußerungen (einschließlich angenommene Veräußerungen, wenn Anteile acht Jahre gehalten wurden) in Bezug auf die Anteile anfallen, (auf Selbstveranlagungsbasis) zu zahlen. Für Anteilhaber, bei denen es sich um Privatpersonen handelt, beträgt der anwendbare irische Steuersatz derzeit 41%. Für Anteilhaber, bei denen es sich um Unternehmen handelt (außer Wertpapierhändler), beträgt der anwendbare irische Steuersatz derzeit 25 %.

Irische Stempelsteuer

Auf die Ausgabe, Übertragung oder Rückgabe von Anteilen fällt keine irische Stempelsteuer (oder sonstige irische Übertragungssteuer) an. Erhält ein Anteilhaber eine Ausschüttung in Sachwerten in Form von Vermögenswerten der Gesellschaft, könnte diese möglicherweise mit der irischen Stempelsteuer belastet werden.

Irische Schenkungs- oder Erbschaftssteuer

Die irische Kapitalerwerbssteuer (zu einem Satz von 33 %) kann auf Schenkungen oder Erbschaften von Anteilen Anwendung finden (ungeachtet des Wohn- oder Geschäftssitzes des Schenkenden oder Schenkungsempfängers), weil die Anteile als in Irland gelegene Vermögenswerte behandelt werden könnten. Schenkungen und Erbschaften von Anteilen sind jedoch von der irischen Kapitalerwerbssteuer ausgenommen, wenn:

- die Anteile sowohl zum Zeitpunkt der Schenkung/Erbschaft als auch am ‚Bewertungstag‘ (gemäß Definition im Sinne der irischen Kapitalerwerbssteuer) in der Schenkung/Erbschaft enthalten sind;
- die Person, von der die Schenkung/Erbschaft entgegengenommen wird, am Datum der Verfügung weder ihren Wohnsitz in Irland hat noch gewöhnlich in Irland ansässig ist; und
- die Person, die die Schenkung/Erbschaft entgegennimmt, am Datum der Schenkung/Erbschaft weder ihren Wohnsitz in Irland hat noch gewöhnlich in Irland ansässig ist.

Erteilung von Informationen

Unter Umständen muss die Gesellschaft Angaben zu Anteilhabern gemäß der EU-Meldepflichten erteilen und das als OECD Common Reporting Standard bekannte System einführen.

Quellensteuer

Die Gesellschaft kann im Herkunftsland ihrer Anlagen einer nicht erstattungsfähigen Quellensteuer auf Dividenden und

Zinsen sowie einer Kapitalertragsteuer unterliegen.

FATCA

Irland hat mit den Vereinigten Staaten von Amerika ein zwischenstaatliches Abkommen (das „IGA“) im Zusammenhang mit dem FATCA geschlossen, einer gemeinhin als „Modell 1“-Abkommen bekannten Variante. Irland hat auch Vorschriften erlassen, um die Bestimmungen des IGA in irisches Recht aufzunehmen. Die Gesellschaft beabsichtigt, ihr Geschäft weiterhin so zu führen, dass gewährleistet ist, dass sie gemäß den IGA-Bedingungen als FATCA-konform gilt. Sofern keine Ausnahmeregelung gilt, muss sich die Gesellschaft bei der US-Steuerbehörde (US Internal Revenue Service) als berichtendes Finanzinstitut („Reporting Financial Institution“) im Sinne des FATCA registrieren und der irischen Steuerbehörde (Irish Revenue Commissioners) Angaben zu Anteilhabern machen, die im Sinne des FATCA spezifizierte US-Personen, nicht teilnehmende Finanzinstitute oder passive nicht teilnehmende ausländische Rechtssubjekte (NFFEs) sind, die von spezifizierten US-Personen kontrolliert werden. Ausnahmen von der Verpflichtung zur FATCA-Registrierung und zur Meldung von FATCA-relevanten Information sind nur unter begrenzten Umständen verfügbar. Alle Informationen, die die Gesellschaft den irischen Steuerbehörden meldet, werden gemäß der IGA an die US-Steuerbehörden weitergegeben. Es ist möglich, dass die irischen Steuerbehörden diese Informationen im Rahmen eines Doppelbesteuerungsabkommens, einer zwischenstaatlichen Vereinbarung oder eines Systems zum Informationsaustausch auch an andere Steuerbehörden weitergeben.

Die Gesellschaft dürfte in Bezug auf ihre Einkünfte aus US-Quellen generell nicht der FATCA-Quellensteuer unterliegen, solange sie ihre FATCA-Verpflichtungen erfüllt. Die FATCA-Quellensteuer käme für an die Gesellschaft geleistete Zahlungen aus US-Quellen nur in Frage, wenn die Gesellschaft ihren Registrierungs- und Berichtspflichten unter FATCA nicht nachgekommen ist und die US-Steuerbehörden die Gesellschaft im Sinne von FATCA ausdrücklich als „nicht teilnehmendes Finanzinstitut“ identifiziert haben.

Bedeutung der Begriffe

Bedeutung von „Ansässigkeit“ bei Unternehmen

Eine Gesellschaft, deren zentrale Verwaltung und Leitung sich in Irland befindet, gilt unabhängig von dem Ort ihrer Gründung als im steuerrechtlichen Sinne in Irland ansässig. Eine Gesellschaft, deren zentrale Verwaltung und Leitung sich nicht in Irland befinden, die aber in Irland gegründet wurde und ist in Irland steueransässig, es sei denn, die Gesellschaft wird unter einem Doppelbesteuerungsabkommen zwischen Irland und einem anderen Land als nicht in Irland ansässig betrachtet.

Bedeutung von „Ansässigkeit“ bei natürlichen Personen

Eine natürliche Person gilt in einem bestimmten Kalenderjahr als im steuerrechtlichen Sinne in Irland ansässig, wenn sie:

1. in dem betreffenden Kalenderjahr mindestens 183

Tage in Irland verbringt; oder

2. unter Berücksichtigung der in dem betreffenden Kalenderjahr in Irland verbrachten Tage zusammen mit den im vorhergehenden Jahr in Irland verbrachten Tagen mindestens 280 Tage in Irland verbringt. Die Anwesenheit einer natürlichen Person in Irland von weniger als 30 Tagen in einem Kalenderjahr wird für diese „Zweijahresprüfung“ nicht berücksichtigt.

Eine natürliche Person gilt als in Irland an einem Tag anwesend, wenn diese natürliche Person zu irgendeinem Zeitpunkt an diesem Tag persönlich in Irland anwesend ist.

Bedeutung von „gewöhnlicher Aufenthalt“ bei natürlichen Personen

Der Ausdruck „gewöhnlicher Aufenthalt“ im Gegensatz zu „Ansässigkeit“ bezieht sich auf die gewöhnlichen Lebensumstände einer Person und bedeutet die Ansässigkeit an einem Ort mit einer gewissen Dauerhaftigkeit. Eine natürliche Person, die in Irland drei aufeinander folgende Steuerjahre ansässig gewesen ist, hat ab dem vierten Steuerjahr ihren gewöhnlichen Aufenthalt in Irland. Eine natürliche Person, die ihren gewöhnlichen Aufenthalt in Irland gehabt hat, hat ab dem Ende des dritten aufeinander folgenden Steuerjahres, in dem sie nicht in Irland ansässig war, dort nicht mehr ihren gewöhnlichen Aufenthalt. Somit behält eine natürliche Person, die 2026 in Irland ansässig ist und ihren gewöhnlichen Aufenthalt hat und in diesem Jahr Irland verlässt, bis zum Ende des Steuerjahres 2029 ihren gewöhnlichen Aufenthalt in Irland.

Vereinigtes Königreich

Allgemeines

Die nachfolgenden Aussagen über die Besteuerung im Vereinigten Königreich dienen zur allgemeinen Orientierung in Hinsicht auf die zu erwartende steuerrechtliche Behandlung von Anteilhabern im Vereinigten Königreich. Es handelt sich hierbei um keine umfassende Zusammenfassung des Steuerrechts des Vereinigten Königreichs in Hinsicht auf alle Anlegerklassen und es ist nicht als rechtliche oder steuerliche Beratung von Anlegern gedacht. Potenzielle Anleger müssen sich in Hinsicht auf sämtliche steuerlichen Sachverhalte im Zusammenhang mit einer Anlage in der Gesellschaft an ihre eigenen professionellen Berater wenden.

Die nachfolgenden Aussagen beziehen sich auf Anteilhaber, die Anteile als Anlage halten (im Gegensatz zu Wertpapierhändlern, Versicherern und bestimmten Trusts), und beruhen auf dem aktuellen britischen Steuerrecht, wie es in England und Wales angewandt wird, sowie auf der von den britischen Steuerbehörden veröffentlichten, zum Zeitpunkt der Veröffentlichung dieses Prospekts geltenden Rechtspraxis (die möglicherweise für die britischen Steuerbehörden nicht verbindlich ist). Beides kann sich jederzeit ändern, möglicherweise auch rückwirkend. Die Aussagen gelten nicht für Anteilhaber im Vereinigten Königreich, die steuerbefreit sind oder besonderen steuerrechtlichen Regelungen unterliegen (u.a. Pensionsfonds). Wie bei allen Anlagenarten besteht keine

Garantie dafür, dass die zum Zeitpunkt, zu dem die Investition in die Gesellschaft getätigt wird, gültige steuerliche Lage auf unbestimmte Zeit weiter besteht. Die nachfolgenden Aussagen beziehen sich ausschließlich auf die steuerliche Behandlung im Vereinigten Königreich für Privatpersonen mit Wohnsitz, gewöhnlichem Wohnsitz oder Domizil im Vereinigten Königreich und im Vereinigten Königreich ansässige Unternehmen, die in die Anteile der Gesellschaft investieren. Diese Zusammenfassung gilt nicht für im Vereinigten Königreich ansässige Unternehmen, bei denen eine (direkte oder indirekte) Beteiligung an mindestens 25 % der Gewinne der Gesellschaft oder eines Fonds angenommen wird.

Die Gesellschaft

Unter der Voraussetzung, dass der Verwaltungsrat gewährleistet, dass die zentrale Verwaltung und Kontrolle der Gesellschaft außerhalb des Vereinigten Königreichs verbleibt und die Gesellschaft keine Geschäftstätigkeit im Vereinigten Königreich ausübt, dürfte die Gesellschaft in Hinsicht auf ihre Einkünfte oder Kapitalerträge nicht im Vereinigten Königreich körperschaftsteuerpflichtig sein.

Die Offshore Funds Regulations

Das Taxation (International and Other Provisions) Gesetz von 2010 und die Offshore Funds (Tax) Regulations 2009 (in der jeweils gültigen Fassung) (die „**Vorschriften**“) enthalten Bestimmungen, die möglicherweise für im Vereinigten Königreich steueransässige Anleger in Offshore-Fonds Anwendung finden.

Die Vorschriften sehen vor, dass ein im Vereinigten Königreich steueransässiger Anleger, der einen Anteil an einem Offshore-Fonds hält, sofern dieser Offshore-Fonds kein „Reporting Fund“ ist, Gewinne, die der Anleger beim Verkauf bzw. einer anderweitigen Veräußerung dieses Anteils erzielt, im Vereinigten Königreich als Einkommen zu versteuern hat und nicht als steuerpflichtigen Gewinn, sofern keine Ausnahme Anwendung findet.

Alternativ hierzu sind Gewinne eines im Vereinigten Königreich steuerpflichtigen Anlegers, der einen Anteil an einem Offshore-Fonds hält (sofern dieser Offshore-Fonds im Hinblick auf anlegende Unternehmen mit Sitz im Vereinigten Königreich den vorstehend angesprochenen „Test eines nichtqualifizierenden Investments“ nicht erfüllt), der während des gesamten Zeitraums, während dem der Anteil gehalten wurde, von den britischen Steuerbehörden als ein „Reporting Fund“ genehmigt wurde, beim Verkauf oder einer anderweitigen Veräußerung des Anteils erzielt werden, kapitalertragsteuerpflichtig und nicht einkommensteuerpflichtig (bzw. körperschaftsteuerpflichtig, falls die Anleger im Vereinigten Königreich körperschaftsteuerpflichtig sind).

Ist ein Offshore Fonds während eines Teils des Zeitraums, während dem der im Vereinigten Königreich Steuerpflichtige den Anteil hält, kein „Reporting Fund“, aber für den verbleibenden Zeitraum ein „Reporting Fund“, kann der Anteilinhaber möglicherweise die Entscheidung treffen, den bei der Veräußerung erzielten Gewinn anteilig abzurechnen. Das bedeutet, dass der Anteil am Gewinn, der während der Zeit erzielt wurde, während der der Offshore Fund ein „Reporting Fund“ war, als Kapitalertrag zu versteuern wäre.

Unter diesen Umständen gelten für diese Entscheidungen ab dem Tag, an dem der Offshore Fonds seinen Status ändert, bestimmte Fristen, während denen sie getroffen werden müssen.

Falls ein Offshore-Fonds den Test eines nichtqualifizierenden Investments („Non-qualifying Investment Test“) nicht besteht (dazu dürfen nicht mehr als 60 % der Vermögenswerte eines Offshore-Fonds aus Anleihen oder anderen verzinslichen oder wirtschaftlich äquivalenten Vermögenswerten bestehen), gilt ungeachtet dessen, ob der Offshore-Fonds ein „Reporting Fund“ ist, dass ein körperschaftsteuerpflichtiger, im Vereinigten Königreich ansässiger Anleger gemäß der Rechnungslegung zum beizulegenden Zeitwert Einkommensteuer auf alle Erträge und Gewinne aus und auf die Wertschwankungen von seiner Beteiligung am Offshore-Fonds zu entrichten hat (berechnet zum Ende des jeweiligen Berichtszeitraums des Anlegers und zum Datum der Veräußerung der Beteiligung).

Unterschiedliche Anteilsklassen der Gesellschaft werden bei der Feststellung ob sie für die Zwecke der Vorschriften „Offshore Funds“ darstellen, einzeln in Erwägung gezogen.

Es ist zu beachten, dass „Veräußerung“ („Disposal“) im Sinne des Steuerrechts des Vereinigten Königreichs generell auch eine Rücknahme oder Umschichtung von Beteiligungen zwischen Anteilsklassen der Gesellschaft beinhaltet.

Zum Erhalt des „Reporting Fund“ Status für eine bestimmte Anteilsklasse muss der Verwaltungsrat der Gesellschaft innerhalb der vorgeschriebenen Fristen für die bestimmte Anteilsklasse bei den Steuerbehörden des Vereinigten Königreichs einen Antrag auf Klassifizierung als „Reporting Fund“ stellen und den Steuerbehörden des Vereinigten Königreichs gegenüber nachweisen, dass die jeweilige Anteilsklasse die jeweiligen für den „Reporting Fund“ Status geltenden Regelungen erfüllt.

Zum Datum dieses Prospekts hat die Gesellschaft erfolgreich den Status als „Reporting Fund“ für jede aktuell ausgegebene Anteilsklasse bei den britischen Steuerbehörden beantragt, und der Status als „Reporting Fund“ bleibt so lange gültig, wie die jährlichen Anforderungen der Vorschriften erfüllt sind.

Der Verwaltungsrat beabsichtigt, die Geschäfte der Gesellschaft und der Fonds so zu führen, dass die Anforderungen für die Erlangung und Aufrechterhaltung des Status eines „Reporting Fund“ für alle Anteilsklassen jetzt und in Zukunft erfüllt werden. Es kann jedoch nicht zugesichert werden, dass eine Anteilsklasse sich auch künftig als „Reporting Fund“ qualifiziert oder dass der Verwaltungsrat den Status des „Reporting Fund“ für neue Anteilsklassen anstreben wird. Diese Anforderungen umfassen die Berechnung und die Meldung der Erlöse des Offshore-Fonds für jeden einzelnen Berichtszeitraum (gemäß Definition der Steuergesetze des Vereinigten Königreichs) pro Anteil an alle relevanten Anteilinhaber (gemäß Definition für diese Zwecke) und an die britischen Steuerbehörden. Solange der Status des „Reporting Fund“ für eine Anteilsklasse aufrechterhalten wird, sind Anteilinhaber, die im Vereinigten Königreich steueransässig sind und am Ende des jeweiligen Berichtszeitraums, auf den

die gemeldeten Erlöse entfallen, die Beteiligung an dieser Anteilsklasse halten, in Hinsicht auf den jeweils höheren Betrag – die ausbezahlten Barausschüttungen oder den proportionalen Anteil am vollen Betrag des gemeldeten Ertrags – einkommen- bzw. körperschaftsteuerpflichtig. Das gemeldete Einkommen gilt in Hinsicht auf Anteilinhaber im Vereinigten Königreich als an dem Tag erzielt, an dem der Bericht durch den Verwaltungsrat eingereicht wird.

Die Aufstellung auszuweisender Erträge von berichtenden Fonds ist der Website zu entnehmen.

Behandlung der von der Gesellschaft eingenommenen Erlöse

Dividendenausschüttungen der Gesellschaft an Gesellschaften, die im Vereinigten Königreich ansässig sind, fallen aller Wahrscheinlichkeit nach unter eine von mehreren Befreiungen von der Körperschaftsteuer des Vereinigten Königreichs. Dividendenausschüttungen an nicht im Vereinigten Königreich ansässige Unternehmen, die über eine permanente Niederlassung im Vereinigten Königreich im Vereinigten Königreich einer Geschäftstätigkeit nachgehen, fallen, insofern als dass die Anteile, die von diesem Unternehmen gehalten werden, von der permanenten Einrichtung gehalten oder in deren Namen genutzt werden, ebenfalls unter die Befreiung der Ausschüttungen von der Körperschaftsteuer im Vereinigten Königreich. Falls eine Anteilsklasse, die einen Offshore-Fonds umfasst, den Test eines nicht qualifizierenden Investments nicht besteht, unterliegen sämtliche solche anlegenden Unternehmen bezüglich ihrer Erträge auf ihre Anteile der britischen Körperschaftsteuer wie oben dargelegt.

In Abhängigkeit von ihren persönlichen Umständen sind natürliche Personen, die im Vereinigten Königreich steuerpflichtig sind, in Hinsicht auf Dividenden oder andere Ausschüttungen von Erträgen durch die Gesellschaft im Vereinigten Königreich steuerpflichtig, ungeachtet dessen, ob diese Ausschüttungen an Anteilinhaber erfolgen oder reinvestiert und im jeweiligen Fonds thesauriert werden, sowie auf nicht ausgeschüttete ausgewiesene Erträge einer Anteilsklasse, die ein Reporting Fund ist, wie vorstehend beschrieben.

Für Anteilsklassen, die den Test eines nicht qualifizierenden Investments im jeweiligen Berichtszeitraum jederzeit bestehen, werden Dividendenausschüttungen und nicht ausgeschüttete gemeldete Erträge solcher Anteilsklassen, die von natürlichen Personen gehalten werden, als Dividendenerträge behandelt und besteuert.

Im Vereinigten Königreich ansässige Anleger, die natürliche Personen sind, unterliegen keiner Einkommensteuer auf eine Dividende, die ein solcher Anleger vereinnahmt, wenn der Gesamtbetrag des von dem Anleger im Steuerjahr vereinnahmten Dividendenertrags (einschließlich Dividenden der Gesellschaft) den Dividendenfreibetrag von 5.000 GBP (der sich im April 2018 auf 2.000 GBP reduziert) nicht übersteigt, der dann zum Satz von null besteuert wird (der „**Dividendenfreibetrag**“). Übersteigen die Dividendenerträge eines im Vereinigten Königreich ansässigen Anlegers, der eine natürliche Person ist, für das Steuerjahr den Dividendenfreibetrag und, sofern sie dem Spitzen Einkommensteuersatz dieses Anlegers unterliegen,

den persönlichen Freibetrag des Anlegers, liegen jedoch unter dem „Basic Rate“-Limit, so unterliegt ein solcher Anleger einer Steuer auf die Dividendenerträge zur „Basic Rate“ für Dividenden von 7,5 %. Sofern solche Dividendenerträge das „Basic Rate“-Limit übersteigen, nicht aber das „Higher Rate“-Limit, unterliegt ein solcher Anleger einer Steuer auf die Dividendenerträge zum höheren Dividendensteuersatz von 32,5 %. Sofern solche Dividendenerträge das „Higher Rate“-Limit übersteigen, unterliegt ein solcher Anleger einer Steuer auf die Dividendenerträge zur „Additional Rate“ von 38,1 %.

Falls eine Anteilsklasse den vorgenannten „Non-qualifying Investment Test“ zu irgendeinem Zeitpunkt in der Rechnungsperiode nicht besteht, werden Ausschüttungen und nicht ausgeschüttete ausgewiesene Erträge in Händen eines privaten Anteilinhabers als Zinsen besteuert. Im Vereinigten Königreich ansässige Anteilinhaber, die in Hinsicht auf Zinseinkünfte nach der „Basic Rate“ steuerpflichtig sind, werden für das Steuerjahr 2017/2018 mit einem Satz von 20 % besteuert. Der Einkommenssteuersatz für das Steuerjahr 2017/2018 beträgt 40 % für Steuerpflichtige der Kategorie „Higher Rate“ und auf 45 % für Steuerpflichtige der Kategorie „Additional Rate“.

Übertragungssteuern: Stamp Duty Reserve Tax und Stamp Duty

Der Verwaltungsrat beabsichtigt, dass das Register der Anteilinhaber sich außerhalb des Vereinigten Königreichs befindet und außerhalb des Vereinigten Königreichs geführt wird. Anleger müssen daher im Rahmen des Erwerbs von Anteilen der Gesellschaft keine britische Stamp Duty Reserve Tax oder Stamp Duty bezahlen. Es kann jedoch sein, dass die Gesellschaft an sich Stamp Duty Reserve Tax oder Stamp Duty im Rahmen des Erwerbs von Wertpapieren, die die Anlagen der Gesellschaft bilden, bezahlen muss. Insbesondere die Stamp Duty Reserve Tax ist im Regelfall zu einem Satz von 0,5 % beim Erwerb von Anteilen an Unternehmen, die im Vereinigten Königreich eingetragen sind, oder die ihr Register der Anteile im Vereinigten Königreich haben oder führen zu zahlen.

Übertragung von Anteilen im Ausland

Anteilinhaber, die natürliche Personen und im Vereinigten Königreich steueransässig sind, werden auf Chapter 2, Part 13 des Income Tax Act von 2007 hingewiesen. Diese Bestimmungen dienen der Verhinderung der Steuerumgehung durch Privatpersonen durch Übertragung von Vermögenswerten oder Einkünften auf Personen (einschließlich Unternehmen), die außerhalb des Vereinigten Königreichs ansässig sind oder ihr Domizil haben. Unter diesen Bestimmungen kann ein Anleger in Hinsicht auf nicht ausgeschüttete Beträge, die im Vereinigten Königreich als steuerpflichtiges Einkommen und Gewinne der Gesellschaft behandelt würden (so auch, wenn die Gesellschaft oder ein Fonds so behandelt würde, als ob sie bzw. er einem Finanzgeschäft mit dem Ziel nachginge durch die Veräußerung von Wertpapieren und finanziellen Gewinnen Profite zu erzielen), steuerpflichtig werden. Es gibt jedoch Bestimmungen, die die natürliche Person von dieser Steuerpflicht unter den vorstehend angeführten Umständen befreien, sofern sie den Steuerbehörden des Vereinigten Königreichs auf zufriedenstellende Weise

darlegen kann, dass (i) der Zweck oder einer der Zwecke der relevanten Transaktionen nicht die Umgehung von Steuern war, bzw. (ii) es sich bei den relevanten Transaktionen um echte Handelsgeschäfte handelte und es bei Betrachtung aller Umstände nicht angemessen wäre, zu dem Schluss zu gelangen, dass eine der relevanten Transaktionen mehr als nur nebenbei für Zwecke der Steuerumgehung ausgelegt war.

Wertpapiertransaktionen

Anteilinhaber werden auf die Gesetze zur Bekämpfung der Steuerhinterziehung in Chapter 1, Part 13 des britischen Einkommenssteuergesetzes von 2007 (Income Tax Act 2007) und Part 15 des Körperschaftsteuergesetzes von 2010 (Corporation Tax Act 2010) hingewiesen, die in Bezug auf Transaktionen mit den Anteilen zur Anwendung kommen könnten, insbesondere bei einem Kauf, Verkauf oder der Umschichtung bestehender Anteile oder einem Antrag auf oder Zeichnung von neuen Anteilen, wenn Anteilinhaber Steuervorteile unter den vorgeschriebenen Bedingungen geltend machen wollen. Vorbehaltlich bestimmter Ausnahmen erlauben es diese Bestimmungen der britischen Steuerbehörde, dem Steuervorteil entgegenzuwirken, indem beispielsweise ein Betrag mit Einkommensteuern belastet wird, der ansonsten ein Kapitalertrag wäre.

Steuerrelevante Erwägungen aufgrund der Pooling-Arrangements

Es wurde eine Prüfung der steuerrechtlichen Auswirkungen der Pooling-Arrangements in Irland durchgeführt. Die angedachten Pooling-Arrangements sind ein verwaltungstechnisches Mittel, das dafür vorgesehen ist die operativen und anderweitigen Kosten zu senken, dabei aber die rechtmäßigen Ansprüche und Verpflichtungen der Anleger der Gesellschaft nicht zu verändern. Dementsprechend wird nicht erwartet, dass eine wesentliche Steuerpflicht aufgrund der Implementierung der Pooling-Arrangements, die im Prospekt beschrieben werden, in Irland entsteht. Es besteht möglicherweise ein Risiko steuerrelevanter Auswirkungen in anderen Ländern, wenn Wertpapiere, die sich in diesen Ländern befinden, wie

in diesem Prospekt beschrieben in den Pool eingebracht werden. Allerdings wären solche zusätzlichen Steuern voraussichtlich nicht wesentlich.

Potenzielle Anleger, die Zweifel in Bezug auf ihre steuerliche Situation haben, sollten bezüglich der Auswirkungen des Kaufs, Besitzes und der Veräußerung von Anteilen auf die irische oder sonstige Besteuerung ihre eigenen unabhängigen Steuerberater konsultieren. Anleger sollten sich ferner bewusst sein, dass sich Steuergesetze und ihre Anwendung oder Auslegung durch die maßgeblichen Steuerbehörden im Laufe der Zeit ändern können. Dementsprechend ist es nicht möglich, die steuerliche Behandlung, die zu einem bestimmten Zeitpunkt zu erwarten ist, genau vorherzusagen.

Management

Verwaltungsratsmitglieder. Die Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind nachfolgend unter Angabe ihrer Haupttätigkeitsfelder aufgeführt.

- Barbara Healy (Irin)

Barbara Healy ist von Beruf Chartered Accountant und hat über 25 Jahre Erfahrung in der Vermögensverwaltungsbranche. Von 2004 bis 2009 war Frau Healy Global Head of Operations sowie Executive Director und Head of Technical Solutions EMEA and Asia bei JPMorgan Hedge Fund Services. Während ihrer Tätigkeit stieg das verwaltete Vermögen von 5 Mrd. USD auf 100 Mrd. USD an, womit sich das Unternehmen als einer der größten Dienstleister auf dem Markt für die Verwaltung von Hedgefonds etablierte. Davor leitete Frau Healy den Betrieb von Tranaut Fund Administration Ltd. (2002 bis 2004), die anschließend von JPMorgan übernommen wurde, und war zuvor bei SEI Investments Europe Limited als Director of Accounting tätig. Frau Healy hatte außerdem Positionen in der Fondsbuchhaltung bei Banker's Trust und der Chase Manhattan Bank inne. Seit 2009 fungierte sie als nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied für Fonds mit Domizil in Irland und auf den Cayman-Inseln (OGAW und Nicht-OGAW) und Verwaltungsgesellschaften. Frau Healy besitzt einen Bachelor of Commerce (Honours) und ein Post-Graduate-Diplom in Unternehmensbuchhaltung des University College Dublin. Sie ist Mitglied des Institute of Chartered Accountants in Ireland (FCA) und des Institute of Directors in Ireland. 2011 absolvierte Frau Healy das High Performance Boards Corporate Governance Programme an der IMD Business School in Lausanne, Schweiz.

- Lim Siong Kwong (Benjamin) Lam Thuon Mine (Luxemburg)

Benjamin Lam hat mehr als 30 Jahre Erfahrung in der Finanzdienstleistungsbranche. Herr Lam hat einen Abschluss von der Universität Manchester und qualifizierte sich als Chartered Accountant im Vereinigten Königreich und in Luxemburg. Er kam 1993 nach Luxemburg und war mehr als 20 Jahre ein Senior Audit Partner bei Deloitte Luxemburg. Von 2017 bis 2019 war er ferner einer der globalen Leiter von Deloitte für deren Auditverfahren im Investmentmanagement und leitete Deloitte's Luxemburger Investmentmanagement- und Finanzdienstleistungsgruppe von 2017 bis 2019. Er war in mehreren Ausschüssen der CSSF (Luxemburger Finanzaufsichtsbehörde) tätig und Mitglied der Luxemburger Regierungsgruppe „Haute Comité de la Place Financière“ (Hoher Ausschuss des Finanzplatzes), eine Think-Tank-Gruppe zum Ausbau der Vermögensverwaltungsbranche in Luxemburg. Ferner war Herr Lam Mitglied der ALFI-Gruppe und Gründungsmitglied der Luxemburger Private

Equity Association (LPEA) Gruppe. Er ist Mitglied der Jury und Prüfer für die Qualifikation als „Professional Chartered Accountant“ (Institut des Réviseurs d'Entreprises – Institut für Wirtschaftsprüfer) in Luxemburg.

- Tom Coghlan (Ire)

Tom Coghlan ist Certified Investment Fund Director des Institute of Banking und verfügt über fundierte Kenntnisse des Investmentfondssektors sowie über Expertise in Unternehmensführung, Aufsicht und Kontrolle. Er ist von der irischen Zentralbank autorisiert und zugelassen. Tom Coghlan qualifizierte sich in Irland als Fellow des Institute of Chartered Accountants bei PricewaterhouseCoopers. Von 2004 bis 2013 war er Verwaltungsratsmitglied von Citi Global Markets und Leiter des paneuropäischen Aktienvertriebs in Irland. In dieser Funktion hatte er die Verantwortung für einen breit gefächerten Kundenstamm, darunter „Long-only-Institutionen“, Hedgefonds, thematische Fonds und Anbieter strukturierter Produkte. Von 2000 bis 2004 war Tom Coghlan Senior Portfolio Manager in der Vermögensverwaltungsabteilung von NCB Stockbrokers. Er hat einen Bachelor of Arts von der UCD in Wirtschaftstheorie (Pure Economics) und wurde im Jahr 2000 als Börsenmakler an der irischen Börse zugelassen.

- Rebecca Bridger (Vereinigtes Königreich)

Frau Bridger ist (nicht praktizierende) qualifizierte Rechtsanwältin, die als Leiterin von EMEA Funds Management im Team EMEA Funds Management Team für den Investmentmanagement-Bereich der State Street Corporation tätig ist. In ihrer Funktion managt und überwacht sie den täglichen Produktlebenszyklus der gepoolten Fonds von State Street Investment Management mit Domizil in Europa. Bevor sie zu State Street Investment Management wechselte war Frau Bridger für die Walbrook Capital LLP, einem Family Office, als unternehmensinterne Beraterin tätig und beriet zu allen Angelegenheiten, von Governance bis zur Aushandlung verschiedener Handelsverträge. Zuvor war Frau Bridger im Produktteam von BGI/BlackRock mit Schwerpunkt auf die Governance von irischen und Cayman-Fonds tätig. Während ihrer Zeit bei BGI war Frau Bridger auch hinsichtlich der rechtlichen und Governance-Aspekte im Zusammenhang mit der Übernahme der gepoolten Fonds von BGI durch BlackRock involviert.

Frau Bridger absolvierte ihre Ausbildung bei der Eversheds LLP, wo sie sich 2009 als Rechtsanwältin qualifizierte. Sie hat einen Abschluss in Rechtswissenschaften von der Universität Exeter und anschließend vom College of Law nach erfolgreichem Abschluss ihres Legal Practice Course (praxisbezogenes postgraduales Studium der Rechtswissenschaften).

- Eric Linnane (Ire)

Eric Linnane verfügt über mehr als 30 Jahre Erfahrung in der Finanzdienstleistungsbranche und ist ein Managing Director der Verwaltungsgesellschaft. Er bekleidet bei der Verwaltungsgesellschaft die Position des Head of Investment Operations and Outsourcing.

Bevor er zu State Street Global Advisors Ireland Limited kam, war Eric Linnane in einer Reihe von Positionen in den Bereichen Treasury und Retail Banking der Bank of Ireland Group tätig. Eric kam 1997 als Operations-Spezialist zu SSIM Ireland und leitete eine Reihe von verschiedenen Teams in den Bereichen Middle Office und Relationship Management, bevor er seine derzeitige Position übernahm. Zu seinen Aufgaben und Verantwortlichkeiten gehörte die Leitung von Teams innerhalb des Portfolio Construction Teams, die für die Einhaltung von Vorschriften vor und nach dem Handel, die Generierung von Handelsaufträgen, die Zuteilung von Handelsgeschäften, die Abwicklung von Handelsgeschäften, das Währungsmanagement sowie die Sachübertragung bzw. den Transfer von Vermögenswerten über mehrere Anlageklassen hinweg verantwortlich waren. Dabei erwarb Eric Linnane umfangreiche Erfahrungen im Front-, Middle- und Back-Office-Bereich. Er leitete außerdem Teams im Bereich Relationship Management bei State Street Global Advisors Ireland Limited, die für Kundenbeziehungsmanagement, Marketing, Geschäfts- und Vertriebsunterstützung sowie Performance-Berichterstattung verantwortlich waren, wodurch er Erfahrung in der direkten Kundenbetreuung und im Relationship Management sammeln konnte. Eric Linnane hat seine derzeitige Funktion im Jahr 2013 übernommen, die auch das Management des Outsourcing-Rahmens für die Verwaltungsgesellschaft umfasst. Er hat einen Bachelor of Commerce vom University College Dublin und besitzt die Berufsbezeichnung Certified Investment Fund Director. Er ist Verwaltungsratsmitglied bei State Street ICAV und war zuvor als Verwaltungsratsmitglied bei State Street Global Advisors Ireland Limited tätig.

Der Verwaltungsrat ist für die Führung der Geschäfte der Gesellschaft zuständig. Der Verwaltungsrat hat (a) die Verwaltung der Geschäfte der Gesellschaft, einschließlich der Verantwortung für die Erstellung und Führung der Bücher und Aufzeichnungen der Gesellschaft und damit verbundene Buchführungsangelegenheiten, einschließlich der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil, an den Administrator; (b) die Verwahrung der Vermögenswerte der Gesellschaft an die Verwahrstelle; (c) die Verantwortung für die Anlageverwaltung, einschließlich des Erwerbs und der Veräußerung der Vermögenswerte der Gesellschaft, an den Anlageverwalter; und (d) die Dienstleistungen der Registerstelle, einschließlich der Führung des Registers der Anteilinhaber, an die Registerstelle übertragen. Die Satzung schreibt kein Ausscheiden der Verwaltungsratsmitglieder aus Altersgründen und auch keine Ablösung der Verwaltungsratsmitglieder durch Rotation vor. Die Satzung legt fest, dass ein Verwaltungsratsmitglied Transaktionen oder

Vereinbarungen mit der Gesellschaft bzw. Transaktionen oder Vereinbarungen, welche die Belange der Gesellschaft berühren, abschließen kann, sofern er dem Verwaltungsrat Art und Umfang seiner wesentlichen Eigeninteressen offengelegt hat. Die Gesellschaft hat den Verwaltungsratsmitgliedern Schadloshaltungen in Bezug auf Verluste oder Schäden zugesichert, die diesen entstehen könnten, sofern diese nicht aus Fahrlässigkeit, Unterlassung, Verletzung von Pflichten oder Vertrauensbruch gegenüber der Gesellschaft resultieren.

Die Anschrift der Verwaltungsratsmitglieder ist der eingetragene Sitz der Gesellschaft.

Die Verwaltungsgesellschaft. Die Gesellschaft hat State Street Global Advisors Europe Limited die Verantwortung für die Aufgaben der täglichen Verwaltung ihrer Geschäfte übertragen, vorbehaltlich der Gesamtüberwachung durch den Verwaltungsrat gemäß einem Verwaltungsvertrag vom 1. August 2021 (der „**Verwaltungsvertrag**“). Die Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Anlageverwaltung bezogen auf die Vermögenswerte der Gesellschaft, die Verwaltung der Gesellschaft und die Umsetzung der Vertriebs- und Marketingpolitik der Gesellschaft und der Fonds.

Der Verwaltungsvertrag sieht vor, dass Ernennung der Verwaltungsgesellschaft so lange wirksam bleibt, bis er von einer der Parteien unter Einhaltung einer Frist von mindestens 90 Tagen gekündigt wird, sofern nicht die beiden Parteien schriftlich etwas anderes vereinbaren. Unter gewissen Umständen (z. B. bei der Insolvenz der Verwaltungsgesellschaft, bei einer trotz entsprechender Aufforderung nicht behobenen Vertragsverletzung usw.) kann der Verwaltungsvertrag jedoch auch fristlos durch schriftliche Mitteilung von der Gesellschaft an die Verwaltungsgesellschaft gekündigt werden. Der Verwaltungsvertrag enthält Bestimmungen bezüglich der gesetzlichen Pflichten der Verwaltungsgesellschaft. Die Verwaltungsgesellschaft ist nicht haftbar für der Gesellschaft entstandene Verluste, Verbindlichkeiten, Kosten oder Aufwendungen, es sei denn, diese resultieren aus Betrug, Fahrlässigkeit, vorsätzlicher Pflichtverletzung, vorsätzlicher Nichterfüllung oder Unredlichkeit.

Die Verwaltungsgesellschaft ist eine Private Company Limited by Shares (eine nicht börsennotierte Kapitalgesellschaft nach irischem Recht), die am 4. Dezember 1974 in Irland unter der Registernummer 49934 gegründet wurde und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften als OGAW-Verwaltungsgesellschaft zugelassen wurde.

Die Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft sind:

- Nigel Wightman (Brite)

Nigel Wightman hat über 40 Jahre Erfahrung in der Vermögensverwaltungsbranche. Er begann seine Karriere als Fondsmanager im Jahr 1976 in London, bevor er in leitenden Positionen für NM Rothschild tätig war, zunächst in London, wo er das internationale und Vermögensverwaltungsgeschäft für Privatkunden leitete, und dann in Hongkong, wo er das Asien-Pazifik-Geschäft leitete. Er war acht

Jahre lang Leiter von State Street Investment Management in London und gemeinsamer Managing Director von SSGA in Europa. Als Führungskraft war Nigel Wightman Verwaltungsratsmitglied einer Reihe von Anlageverwaltungsgesellschaften sowie geschlossener und offener Investmentfonds in Jurisdiktionen wie Irland, Vereinigtes Königreich, Luxemburg, Hongkong und Kanada.

Er hat einen BA- und MA-Abschluss in Politik, Philosophie und Wirtschaft (1st class hon) und einen MPhil-Abschluss in Wirtschaft von der Universität Oxford und ist zudem Honorary Fellow des Brasenose College Oxford. In den letzten Jahren war er nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied einer Reihe von Fondsmanagement- und Anlageverwaltungsgesellschaften und ist derzeit nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied von vier solcher Unternehmen, von denen er in drei den Vorsitz innehat; außerdem ist er Mitglied des Investitionsausschusses von drei Wohltätigkeitsorganisationen. Nigel Wightman war 5 Jahre lang nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft. Er ist der Vorsitzende des Nominierungsausschusses und der Organisational Effectiveness Director für die Verwaltungsgesellschaft.

- Margaret Cullen (Irland)

Margaret Cullen ist eine Spezialistin in den Bereichen Corporate Governance und Investmentfonds-Governance. Sie ist CEO und Academic Director des Certified Investment Fund Director Institute (CIFDI), einem gemeinnützigen Fachinstitut des Institute of Banking (IoB), das sich auf die Verbesserung beruflicher Standards im Bereich Investmentfonds-Governance konzentriert.

Sie bekleidete leitende Positionen bei ABN AMRO International Financial Services Company, der irischen Zentralbank, JP Morgan Bank Ireland plc und RBC Dexia Investor Services Ireland Limited. Margaret Cullen hält für das IoB zahlreiche Vorträge über Corporate Governance sowie Bank- und Investmentfonds-Governance. Sie ist Assistenzprofessorin für das University College Dublin (UCD) Centre of Corporate Governance und unterrichtet im Rahmen des Professional Diploma in Corporate Governance in den Bereichen Vergütung von Führungskräften und Verhaltensaspekte bei Leitungsgremien.

Margaret Cullen hat einen BA-Abschluss in Wirtschaftswissenschaften vom University College Dublin, einen MSc-Abschluss in Investment und Treasury von der Dublin City University und einen Doktorgrad in Corporate Governance vom University College Dublin und ist außerdem als nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsräten von zwei weiteren Finanzdienstleistungsunternehmen tätig. Margaret Cullen ist nicht-geschäftsführendes

Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft. Sie ist Vorsitzende des Prüfungsausschusses für die Verwaltungsgesellschaft.

- Ann Prendergast (Irland)

Ann Prendergast ist Executive Vice President sowie Head der Region Europa, Naher Osten und Afrika (EMEA) für SSIM. Sie ist Mitglied der SSIM Operating Group und Vorsitzende des EMEA Executive Committee.

Frau Prendergast ist Chief Executive Officer der State Street Global Advisors Europe Ltd, dem Unternehmen, das für das Geschäft der State Street Investment Management in der Europäischen Union verantwortlich ist. Nachdem sie im Jahr 2000 in das Unternehmen eingetreten war, leitete sie das Vertriebs- und Marketingteam für den irischen Markt.

Bevor sie zu SSIM wechselte war Frau Prendergast für die Bank of Ireland Group sowohl in der Fondsverwaltung als auch im Private-Banking-Bereich tätig.

Sie hat einen Abschluss in Betriebswirtschaft von der Universität Limerick, ist Mitglied der Association of Chartered Certified Accountants (ACCA) und ist Certified Investment Fund Director (CIFD).

- Eric Linnane (Irland)

Eric Linnane verfügt über mehr als 30 Jahre Erfahrung in der Finanzdienstleistungsbranche und ist ein Managing Director der Verwaltungsgesellschaft. Er bekleidet bei der Verwaltungsgesellschaft die Position des Head of Investment Operations and Outsourcing.

Bevor er zu State Street Global Advisors Ireland Limited kam, war Eric Linnane in einer Reihe von Positionen in den Bereichen Treasury und Retail Banking der Bank of Ireland Group tätig. Eric kam 1997 als Operations-Spezialist zu SSGA Ireland und leitete eine Reihe von verschiedenen Teams in den Bereichen Middle Office und Relationship Management, bevor er seine derzeitige Position übernahm. Zu seinen Aufgaben und Verantwortlichkeiten gehörte die Leitung von Teams innerhalb des Portfolio Construction Teams, die für die Einhaltung von Vorschriften vor und nach dem Handel, die Generierung von Handelsaufträgen, die Zuteilung von Handelsgeschäften, die Abwicklung von Handelsgeschäften, das Währungsmanagement sowie die Sachübertragung bzw. den Transfer von Vermögenswerten über mehrere Anlageklassen hinweg verantwortlich waren. Dabei erwarb Eric Linnane umfangreiche Erfahrungen im Front-, Middle- und Back-Office-Bereich. Er leitete außerdem Teams im Bereich Relationship Management bei State Street Global Advisors Ireland Limited, die für Kundenbeziehungsmanagement, Marketing,

Geschäfts- und Vertriebsunterstützung sowie Performance-Berichterstattung verantwortlich waren, wodurch er Erfahrung in der direkten Kundenbetreuung und im Relationship Management sammeln konnte. Eric Linnane hat seine derzeitige Funktion im Jahr 2013 übernommen, die auch das Management des Outsourcing-Rahmens für die Verwaltungsgesellschaft umfasst. Er hat einen Bachelor of Commerce vom University College Dublin und besitzt die Berufsbezeichnung Certified Investment Fund Director. Er ist Verwaltungsratsmitglied bei State Street ICAV und war zuvor als Verwaltungsratsmitglied bei State Street Global Advisors Ireland Limited tätig.

- Scott Sanderson (Brite)

Scott Sanderson kam im Jahr 2018 zu SSIM und ist Managing Director von State Street Global Advisors Limited und Chief Financial Officer bei SSIM für die EMEA-Region. Er ist verantwortlich für die Unterstützung der regionalen Geschäftsleiter von SSIM in der EMEA-Region, damit diese die von der SSIM-Gruppe festgelegten Geschäftsziele ausführen und umsetzen können. Außerdem ist er für alle Aspekte der finanziellen Governance der EMEA-Einheiten von SSIM verantwortlich. Scott Sanderson verfügt über mehr als 22 Jahre Erfahrung in der Vermögensverwaltung. Bevor er zu SSIM kam, bekleidete er verschiedene leitende Positionen im Finanzbereich, unter anderem bei Columbia Threadneedle Investments und der Bank of New York Mellon, und war als geschäftsführendes und nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied bei verschiedenen Anlageverwaltungs- und Fondsmanagementgesellschaften tätig. Er hat einen Honours Degree in Rechnungswesen und Finanzanalyse von der Warwick University und ist Mitglied des Institute of Chartered Accountants in England und Wales. Scott Sanderson ist als nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied in einer Reihe von Gremien tätig, darunter auch in der Verwaltungsgesellschaft, und war zuvor als geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied im Verwaltungsrat von State Street Global Advisors Ireland Limited tätig. Scott Sanderson ist ein Mitglied des Prüfungsausschusses der Verwaltungsgesellschaft.

- Marie-Anne Heeren (Belgien)

Marie-Anne Heeren ist Senior Managing Director, Leiterin der Europa-Gruppe für institutionelle Kunden, Branch-Managerin für die belgische Niederlassung der Gesellschaft. In dieser Funktion leitet sie die Maßnahmen im Bereich Business Development, Relationship Management und Client Service in Europa. Sie ist Mitglied im Senior Leadership Team von SSIM sowie im European Executive Management Team. Zuvor hatte Frau Heeren die Positionen als belgische Branchenmanagerin bei SSGAIL und als Leiterin Kontinentaleuropa bei SSGAIL inne. Ferner war sie Mitglied im Verwaltungsrat von SSGAIL.

Bevor Frau Heeren 2005 zu SSIM kam, war sie fünf Jahre bei JP Morgan Chase tätig, sowohl in London als auch in Brüssel. Sie begann mit dem Ausbildungsprogramm in New York und gewann Erfahrung auf den Märkten für Unternehmensanleihen. In ihren letzten beiden Jahren in der Brüsseler Niederlassung von JP Morgan bekleidete Frau Heeren eine Position im Bereich Kreditverkäufe für institutionelle Anleger in der Benelux-Region.

Sie hat einen Abschluss in Rechtswissenschaften von der Catholic University of Leuven, Belgien, und der Universität Heidelberg, Deutschland.

- Patrick Mulvihill (Irland)

Patrick Mulvihill bringt über 35 Jahre Erfahrung im internationalen Finanzdienstleistungsgewerbe mit und verfügt über fundierte Kenntnisse in Finanz- und Managementberichterstattung, Compliance, operativem Geschäft sowie Risiko- und Kreditfragen in maßgeblichen internationalen Finanzinstituten. Im Laufe seiner Karriere war er an der Entwicklung und Beaufsichtigung maßgeblicher Investitionen in IT-Infrastruktur zur Unterstützung seiner Zuständigkeitsbereiche beteiligt.

Patrick Mulvihill war lange für Goldman Sachs tätig und bekleidete dort eine Reihe leitender Managementpositionen in London und New York. 2006 trat er von seinem Posten als Managing Director: Global Head of Operations am Standort London zurück. In dieser Funktion war er für sämtliche Aspekte von Capital Markets Operations, Asset Management Operations und Payment Operations zuständig. Davor war er Managing Director: Co-Controller am Standort New York und verantwortete alle Aspekte des Berichtswesens in den Bereichen Accounting und Regulatory.

Patrick Mulvihill hat einen Bachelor-of-Commerce-Abschluss vom University College Cork und ist Fellow of Chartered Accountants Ireland. In den letzten Jahren ist er als nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied mehrerer Finanzdienstleister in Irland tätig, befasst sich mit den Bereichen Banking, Brokerage und Fondsmanagement und -verwaltung und führt den Vorsitz von Prüfungs- und Risikoausschüssen.

Anlageverwalter. State Street Global Advisors Europe Limited fungiert zudem als Anlageverwalter für jeden Fonds und ist, unter der Überwachung durch den Verwaltungsrat, verantwortlich für die Anlageverwaltung der Fonds gemäß dem Anlageverwaltungsvertrag. Der Anlageverwalter legt für jeden Fonds ein Anlageverwaltungsprogramm vor und verwaltet die Anlage der Vermögenswerte der Fonds. Der Anlageverwalter und andere Konzerngesellschaften der State Street Corporation, u. a. auch SSIM (wie nachfolgend definiert), bilden die Vermögensverwaltungssparte der State Street Corporation.

Der Anlageverwalter erbringt Anlageverwaltungsdienstleistungen für die Fonds und hat

eine Niederlassung in Polen gegründet, über die er ebenfalls diese Dienstleistungen erbringen kann.

Der Anlageverwalter ist von der Zentralbank zugelassen, und zu seinem Anlageverwaltungsgeschäft gehört insbesondere die Verwaltung anderer zugelassener irischer Organismen für gemeinsame Anlagen.

Der Anlageverwalter kann nach seinem Ermessen alle Befugnisse, Pflichten und Ermessensentscheidungen in Bezug auf die Verwaltung des betreffenden Prozentsatzes derjenigen Fonds, die der Anlageverwalter und ein Unteranlageverwalter von Zeit zu Zeit vereinbaren, an Unteranlageverwalter delegieren. Ein Unteranlageverwalter kann seine Befugnisse an einen anderen Unteranlageverwalter übertragen. Eine solche Ernennung unterliegt der vorherigen Genehmigung des Verwaltungsrats und muss gemäß den Anforderungen der Zentralbank erfolgen. Details zu den für einen Fonds benannten Unteranlageverwaltern werden den Anteilhabern auf Anfrage zur Verfügung gestellt und entweder im maßgeblichen Nachtrag des Fonds oder in den regelmäßigen Berichten der Gesellschaft offengelegt. An einen vom Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter ernannten Unteranlageverwalter zahlbare Gebühren sind von der Verwaltungsgesellschaft aus der TER zu bezahlen.

Die Bedingungen des Verwaltungsvertrags sind im Abschnitt „**Die Verwaltungsgesellschaft**“ näher beschrieben.

Administrator und Registerstelle. Der Administrator wurde gemäß einem Verwaltungsstellenvertrag vom 7. März 2011, in der am 30. September 2014 bzw. 11. November 2016 geänderten Fassung sowie in der durch einen Novations- und Änderungsvertrag mit Wirkung ab dem 1. August 2021 geänderten Fassung, wobei dieser Vertrag zu späteren Zeitpunkten noch geändert werden kann, (der „**Verwaltungsstellenvertrag**“) über die Erbringung von Verwaltungsdienstleistungen für die Verwaltungsgesellschaft in Bezug auf die Gesellschaft ernannt. Der Administrator wurde von der Verwaltungsgesellschaft ferner gemäß dem Verwaltungsstellenvertrag zur Registerstelle für die Anteile in den Fonds ernannt.

Der Administrator ist eine in Irland am 23. März 1992 gegründete Gesellschaft mit beschränkter Haftung und ist letztlich eine hundertprozentige Tochtergesellschaft von State Street Corporation. Das genehmigte Grundkapital von State Street Fund Services (Ireland) Limited beträgt 5.000.000 GBP, ist einem ausgegebenen und eingezahlten Kapital von 350.000 GBP.

Die State Street Corporation ist ein weltweit führender Spezialist im Bereich Anlagedienstleistungen und Anlageverwaltung für anspruchsvolle internationale Anleger. Die State Street Corporation hat ihren Sitz in Boston, Massachusetts, USA, und wird an der New Yorker Börse unter dem Symbol „STT“ gehandelt.

Der Verwaltungsstellenvertrag sieht vor, dass die Ernennung des Administrators so lange wirksam bleibt, bis der Vertrag von einer Partei durch schriftliche Mitteilung an die andere unter Einhaltung einer Frist von mindestens 90 Tagen gekündigt wird. Unter gewissen Umständen (wie z.B. der Insolvenz einer Partei, einer trotz entsprechender

Aufforderung nicht behobenen Vertragsverletzung usw.) kann der Verwaltungsstellenvertrag jedoch auch fristlos durch schriftliche Mitteilung einer Partei an die andere gekündigt werden. Der Verwaltungsstellenvertrag enthält Schadloshaltungen zu Gunsten des Administrators unter Ausschluss von Angelegenheiten, die auf Fahrlässigkeit, Betrug, Unredlichkeit oder vorsätzlicher Nichterfüllung bei der Erfüllung ihrer Aufgaben und Pflichten beruhen.

Der Administrator errichtet, unterhält und aktualisiert regelmäßig das Anteilsregister der Anteilhaber der Fonds, welches im Besitz der Gesellschaft bleibt, und gewährt hierzu berechtigten Personen Einsicht in das Anteilsregister. Der Administrator bewahrt das Anteilsregister der Fonds sowie alle Unterlagen und Aufzeichnungen in seinen Büros in Irland auf bzw. veranlasst deren dortige Aufbewahrung und gewährleistet hierdurch einen vollständigen Nachweis aller von ihr in Zusammenhang mit den Anteilen der Fonds ausgeführten Aktivitäten. Ebenso bewahrt er in seinen irischen Büros weitere, möglicherweise gesetzlich vorgeschriebene, Bücher, Aufzeichnungen und Berichte auf.

Die Verwahrstelle. Die Gesellschaft hat gemäß einem Vertrag zwischen der Gesellschaft und der Verwahrstelle vom 11. Oktober 2016 (der „**Verwahrstellenvertrag**“) State Street Custodial Services (Ireland) Limited zur Verwahrstelle für alle Vermögenswerte der Gesellschaft ernannt; dieser Vertrag kann zu späteren Zeitpunkten noch ergänzt werden. Die Verwahrstelle unterliegt der Aufsicht durch die Zentralbank. Die Verwahrstelle ist eine Private Limited Company, die am 22. Mai 1991 in Irland gegründet wurde.

Die Verwahrstelle ist mit folgenden Hauptfunktionen betraut worden:

- sicherzustellen, dass Verkauf, Ausgabe, Rücknahme, Auszahlung und Annullierung von Anteilen gemäß dem anwendbaren Recht und der Satzung erfolgen;
- sicherzustellen, dass die Berechnung des Werts der Anteile gemäß dem anwendbaren Recht und der Satzung erfolgt;
- den Weisungen der Gesellschaft Folge zu leisten, es sei denn, diese Weisungen verstoßen gegen das anwendbare Recht oder die Satzung;
- sicherzustellen, dass bei Transaktionen mit Vermögenswerten der Gesellschaft der Gegenwert innerhalb der üblichen Fristen überwiesen wird;
- sicherzustellen, dass die Erträge der Gesellschaft gemäß dem anwendbaren Recht und der Satzung verwendet werden;
- die Barbestände und Cashflows der einzelnen Fonds zu überwachen; und
- die Vermögenswerte der Gesellschaft sicher zu verwahren, wozu auch die sichere Verwahrung der Finanzinstrumente, die in Verwahrung genommen werden können, sowie die Überprüfung der Eigentumsverhältnisse von sowie die Führung von Aufzeichnungen über sonstige Vermögenswerte(n)

gehören.

Haftung der Verwahrstelle

Die Verwahrstelle handelt bei der Wahrnehmung ihrer Aufgaben ehrlich, redlich, professionell, unabhängig und ausschließlich im Interesse der Gesellschaft und ihrer Anteilinhaber.

Bei Verlust eines verwahrten Finanzinstruments gemäß der OGAW-Richtlinie und insbesondere Artikel 18 der delegierten Verordnung hat die Verwahrstelle der Gesellschaft unverzüglich ein Finanzinstrument gleicher Art zurückzugeben oder einen entsprechenden Betrag zu erstatten.

Die Verwahrstelle haftet nicht, wenn sie nachweisen kann, dass der Verlust eines verwahrten Finanzinstruments gemäß OGAW-Richtlinie auf äußere Ereignisse, die nach vernünftigem Ermessen nicht kontrolliert werden können und deren Konsequenzen trotz aller angemessenen Anstrengungen nicht hätten vermieden werden können, zurückzuführen ist.

Bei Verlust eines verwahrten Finanzinstruments können die Anteilinhaber die Haftung der Verwahrstelle unmittelbar oder mittelbar über die Gesellschaft geltend machen, vorausgesetzt, dass dies weder zur Verdopplung von Regressansprüchen noch zur Ungleichbehandlung der Anteilinhaber führt. Die Verwahrstelle haftet gegenüber der Gesellschaft auch für sämtliche sonstige Verluste, die diese infolge einer fahrlässigen oder vorsätzlichen Nichterfüllung der Verpflichtungen der Verwahrstelle aus der OGAW-Richtlinie erleidet.

Soweit durch anwendbares Recht zulässig, ist die Verwahrstelle nicht unbedingt haftbar für Folge- oder indirekte oder besondere Schäden oder Verluste, die sich aus Erfüllung oder Nichterfüllung der Pflichten und Aufgaben der Verwahrstelle oder im Zusammenhang damit ergeben.

Übertragung

Die Verwahrstelle ist uneingeschränkt befugt, alle oder einen Teil ihrer Verwahraufgaben zu übertragen, wobei die Haftung der Verwahrstelle nicht durch die Tatsache beeinträchtigt wird, dass sie einen Teil oder alle Vermögenswerte unter ihrer Verwahrung einem Dritten anvertraut. Die Haftung der Verwahrstelle bleibt von einer etwaigen Übertragung ihrer Verwahraufgaben gemäß dem Verwahrstellenvertrag unberührt.

Angaben zu den übertragenen Verwahrungsfunktionen und zu den jeweiligen Beauftragten und Unterbeauftragten sind in Anhang III zu diesem Prospekt enthalten.

Interessenkonflikte

Die Verwahrstelle ist Teil einer internationalen Gruppe von Gesellschaften und Unternehmen, die im normalen Geschäftsgang parallel für eine große Zahl von Kunden sowie für eigene Rechnung tätig sind, was zu tatsächlichen oder potenziellen Konflikten führen kann. Interessenkonflikte ergeben sich, wenn die Verwahrstelle oder ihre Konzerngesellschaften im Rahmen des Verwahrstellenvertrags oder gesonderter vertraglicher oder

sonstiger Vereinbarungen Tätigkeiten ausführen.

Zu diesen Tätigkeiten können zählen:

- die Erbringung von Nominee-, Verwaltungs-, Register- und Transferstellen-, Research-, Wertpapierleihstellen-, Anlageverwaltungs-, Finanzberatungs- und/oder sonstige Beratungsleistungen für die Gesellschaft;
- die Ausführung von Bank-, Vertriebs- und Handelsgeschäften einschließlich Devisen-, Derivate-, Kredit-, Makler-, Market-Making- und sonstige Finanztransaktionen mit der Gesellschaft als Auftraggeber oder in ihrem eigenen Interesse oder für andere Kunden.

Im Zusammenhang mit den vorstehenden Tätigkeiten wird/werden die Verwahrstelle oder ihre Konzerngesellschaften:

- versuchen, aus solchen Tätigkeiten Kapital zu schlagen und ist/sind befugt, Gewinne oder Gegenleistungen in jeder Form zu vereinnahmen und einzubehalten und muss/müssen der Gesellschaft nicht die Art oder Höhe solcher Gewinne oder Gegenleistungen offenlegen einschließlich etwaiger Gebühren, Kosten, Provisionen, Umsatzanteile, Spreads, Aufschläge, Abschläge, Zinsen, Nachlässe, Disagios oder sonstigem im Zusammenhang mit solchen Tätigkeiten erzielten Nutzen;
- kann/können sie Wertpapiere oder andere Finanzprodukte oder Instrumente als Auftraggeber in eigenem Interesse, im Interesse ihrer Konzerngesellschaften oder für ihre anderen Kunden kaufen, verkaufen, ausgeben, handeln oder halten;
- kann/können sie in dieselbe oder die entgegengesetzte Richtung der vorgenommenen Transaktionen handeln, auch aufgrund von in ihrem Besitz befindlichen Informationen, die der Gesellschaft nicht zur Verfügung stehen;
- kann/können sie für andere Kunden, auch für Mitbewerber der Gesellschaft, dieselben oder ähnliche Dienstleistungen erbringen; und
- kann/können sie von der Gesellschaft Gläubigerrechte gewährt bekommen und diese ausüben.

Die Gesellschaft kann eine Konzerngesellschaft der Verwahrstelle einsetzen, um für Rechnung der Gesellschaft Devisen-, Kassa- oder Swapgeschäfte auszuführen. In solchen Fällen agiert die Konzerngesellschaft als Auftraggeber, nicht als Makler, Vertreter oder Treuhänder der Gesellschaft. Die Konzerngesellschaft wird versuchen, aus diesen Geschäften Kapital zu schlagen, und ist befugt, etwaige Gewinne einzubehalten und der Gesellschaft nicht offenzulegen. Die Konzerngesellschaft geht solche Geschäfte zu den mit der Gesellschaft vereinbarten Bestimmungen und Bedingungen ein.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

Werden liquide Mittel der Gesellschaft bei einer Konzerngesellschaft eingelegt, die eine Bank ist, entsteht ein potenzieller Konflikt in Bezug auf die Zinsen, die die Konzerngesellschaft (gegebenenfalls) einem solchen Konto gutschreibt oder belastet, und die Gebühren oder den sonstigen Nutzen, die/den sie aus dem Halten solcher liquiden Mittel als Bank, nicht als Treuhänder, bezieht.

Auch der Anlageverwalter kann ein Kunde oder Kontrahent der Verwahrstelle oder ihrer Konzerngesellschaften sein.

Aktuelle Informationen zur Verwahrstelle, ihren Aufgaben, potenziellen Konflikten, den von der Verwahrstelle übertragenen Verwahrungsfunktionen, der Liste mit Beauftragten und Unterbeauftragten und Interessenkonflikten, die sich aus einer solchen Übertragung ergeben können, erhalten Anteilinhaber auf Anfrage.

Zahlstelle. Die lokalen Gesetze/Bestimmungen in bestimmten Mitgliedstaaten des EWR können vorsehen, dass (i) die Gesellschaft Facilities Agents / Zahlstellen / Vertreter / Vertriebsstellen / Korrespondenzbanken bestellt (diese werden im Folgenden jeweils als eine „Zahlstelle“ bezeichnet, und eine solche Bestellung kann ungeachtet dessen erfolgen, ob eine gesetzliche oder aufsichtsrechtliche Pflicht besteht) und (ii) diese Zahlstellen Konten führen, über die Zeichnungs- und Rücknahmegelder oder Dividenden gezahlt werden können. Anteilinhaber, die sich entscheiden oder nach lokalen Bestimmungen verpflichtet sind, Zeichnungsgelder über eine Zahlstelle zu zahlen bzw. Rücknahmegelder oder Dividenden über eine solche entgegenzunehmen, unterliegen dem Kreditrisiko der Zahlstelle in Bezug auf (a) die Zeichnungsgelder für Anlagen in einem Fonds, die vor Überweisung dieser Gelder an den Administrator für Rechnung des betreffenden Fonds von der Zahlstelle gehalten werden, und (b) die Rücknahmegelder und Dividendenzahlungen, die vor der Auszahlung an den betreffenden Anteilinhaber (nach Überweisung durch die Gesellschaft) von der Zahlstelle gehalten werden. Die Gebühren und Kosten der Zahlstellen werden zu normalen und marktüblichen Sätzen vom Fonds getragen, für die eine Zahlstelle bestellt wurde. Alle Anteilinhaber des betreffenden Fonds, für den eine Zahlstelle bestellt wird, können die Dienste der von oder im Namen der Verwaltungsgesellschaft bestellten Zahlstellen in Anspruch nehmen.

Globale Vertriebsstelle. State Street Global Advisors Europe Limited wurde außerdem gemäß dem Verwaltungsvertrag zur globalen Vertriebsstelle der Gesellschaft bestellt und mit der Verkaufsförderung und dem Marketing für die Anteile beauftragt.

Die Bedingungen des Verwaltungsvertrags sind im Abschnitt „**Die Verwaltungsgesellschaft**“ näher beschrieben.

Unteranlageverwalter. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter haben die folgenden diskretionären Unteranlageverwalter für bestimmte Fonds ernannt, wie im maßgeblichen Nachtrag angegeben, insbesondere:

- i. State Street Global Advisors Trust Company (ernannt gemäß einem Unteranlageverwaltungsvertrag vom 1. August 2021, in der jeweils gültigen Fassung).
- ii. State Street Global Advisors Limited (ernannt

gemäß einem Unteranlageverwaltungsvertrag vom 1. August 2021).

- iii. State Street Global Advisors Singapore Limited (ernannt gemäß einem Unteranlageverwaltungsvertrag vom 1. August 2021).

Gemäß dem jeweiligen Unteranlageverwaltungsvertrag haften weder der Unteranlageverwalter noch seine Geschäftsführer, leitenden Angestellten, Beschäftigten oder Vertreter für Verluste oder Schäden, die unmittelbar oder mittelbar vom Unteranlageverwalter bei oder im Zusammenhang mit der Erfüllung seiner Pflichten und Aufgaben verursacht werden, es sei denn, diese Verluste oder Schäden sind auf Fahrlässigkeit, vorsätzliche Nichterfüllung, Unredlichkeit, vorsätzlicher Pflichtverletzung oder Betrug seitens des Unteranlageverwalters bei der Erfüllung seiner Aufgaben zurückzuführen oder in diesem Zusammenhang entstanden. Der Unteranlageverwalter haftet unter keinen Umständen für konkrete, mittelbare oder beiläufige Schäden, Folgeschäden oder Strafe einschließenden Schadenersatz jedweder Art, die bzw. der auf die Erfüllung seiner Aufgaben zurückzuführen ist.

Jeder Unteranlageverwaltungsvertrag bleibt in Kraft, bis ihn der Anlageverwalter oder der Unteranlageverwalter mit einer Frist von neunzig (90) Tagen gegenüber der jeweils anderen Partei schriftlich kündigt oder bis ihn der Anlageverwalter aus anderen Gründen im Einklang mit den Bedingungen des jeweiligen Unteranlageverwaltungsvertrags kündigt.

Gesellschaftssekretär. Der Gesellschaftssekretär der Gesellschaft ist Matsack Trust Limited.

Wirtschaftsprüfer. Ernst & Young fungieren als Wirtschaftsprüfer der Gesellschaft.

Rechtsberater. Matheson fungiert als Rechtsberater der Gesellschaft.

VRC-Unterdepotbank und VRC-Handels- und Abrechnungsvertreter für den Anleihenhandel am Interbankenmarkt. Die HSBC Bank (China) Company Limited wurde als Unterdepotbank und als Handels- und Abrechnungsvertreter für den Anleihenhandel am Interbankenmarkt für die betreffenden Fonds zum Zwecke von Anlagen über das bzw. die CIBM Direct Access Programme(s) und/oder die QFIs ernannt.

Wo erhalten Sie weitere Informationen zu den Fonds?

Kopien folgender Dokumente können während der normalen Geschäftszeiten an jedem Handelstag an dem im Adressverzeichnis angegebenen eingetragenen Sitz des Anlageverwalters oder online unter www.ssga.com eingesehen werden:

- a) die Satzung; und
- b) die OGAW-Vorschriften und die gemäß diesen herausgegebenen OGAW-Vorschriften der Zentralbank.

Darüber hinaus können die Satzung der Gesellschaft und die Jahres- und Halbjahresberichte kostenlos beim Administrator angefordert oder am eingetragenen Sitz des Administrators an jedem Handelstag während der normalen Geschäftszeiten eingesehen werden.

Der jeweils aktuelle geprüfte Jahresabschluss der Gesellschaft wird nach Veröffentlichung am eingetragenen Sitz des Administrators an jedem Handelstag während der normalen Geschäftszeiten zur Verfügung gestellt.

Einzelheiten zum Portfolio jedes Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil jedes Fonds finden Sie auf der Website.

INFORMATIONEN FÜR ANTEILINHABER: Telefon: +44 (0)203 395 6888, Website: **Error! Hyperlink reference not valid.** <http://www.ssga.com/>

Anteilinhaber können Anfragen telefonisch unter der oben genannten Nummer an die Fonds richten. Email: spdrseurope@SSGA.com.

Niemand wurde ermächtigt, im Zusammenhang mit dem Angebot von Anteilen der einzelnen Teilfonds andere Informationen zu verbreiten oder andere Erklärungen abzugeben, als die in diesem Prospekt enthaltenen. Falls derartige Informationen gegeben oder Behauptungen aufgestellt werden, darf nicht davon ausgegangen werden, dass sie von der Gesellschaft genehmigt worden sind. Weder die Aushändigung dieses Prospekts oder maßgeblicher Nachträge noch ein Verkauf von Anteilen bedeuten unter irgendwelchen Umständen, dass die hierin enthaltenen Informationen zu einem nach dem Datum dieses Prospekts liegenden Zeitpunkts richtig sind.

Anhang I – Definitionen

Zugangsprogramm(e)	bestehende oder zukünftige „Zugangs“-Produkte oder -Programme wie QFI, Stock Connect, das bzw. die CIBM Direct Access Programme(s), Bond Connect oder andere Anlageprogramme, über die ein Fonds Zugang zu Anlagen in der VRC erhält;
Verwalter	State Street Fund Services (Ireland) Limited oder eine andere jeweils gemäß den Anforderungen der Zentralbank von der Gesellschaft für die Erbringung von Verwaltungs- und Buchhaltungsdienstleistungen bestellte Gesellschaft;
Satzung	die Gründungsurkunde und Satzung der Gesellschaft in ihrer jeweils gültigen Fassung;
Wirtschaftsprüfer	bezeichnet Ernst & Young oder ein anderes Unternehmen, das von Zeit zu Zeit als Wirtschaftsprüfer der Gesellschaft bestellt werden kann;
Autorisierter Teilnehmer	in Bezug auf ETF-Anteile ein Market Maker oder eine Makler/Dealer-Einheit, die einen Vertrag als teilnehmende Händler für die Zwecke der direkten Ausgabe und/oder Rücknahme von ETF-Anteilen eines Fonds mit dem Unternehmen ist (d.h. Primärmarkt);
Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer	sind auf ETF-Anteile bezogene Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer, in denen die Einzelheiten zu den Verfahren für die direkte Zeichnung und/oder Rücknahme von ETF-Anteilen eines Fonds bei der Gesellschaft (d. h. auf dem Primärmarkt) aufgeführt sind und die ausschließlich für autorisierte Teilnehmer beim Anlageverwalter erhältlich sind;
Basiswährung	die Währung, in der der Nettoinventarwert der einzelnen Fonds berechnet wird, oder auf die eine Anteilsklasse lautet;
Bond-Connect-Stellen	bezeichnet die Börsen, Handelssysteme, Abrechnungssysteme, staatlichen, aufsichtsbehördlichen oder steuerlichen Organe, die Dienstleistungen für Bond Connect erbringen und/oder Bond Connect sowie Tätigkeiten im Zusammenhang mit Bond Connect regulieren, insbesondere PBOC, HKMA, Hong Kong Exchanges and Clearing Limited, CFETS, CMU, CCDC und SHCH sowie jede andere Regulierungs- oder sonstige Behörde oder staatliche Stelle mit rechtlicher oder sonstiger Zuständigkeit oder Befugnis im Zusammenhang mit Bond Connect;
Bond-Connect-Wertpapiere	bezeichnet alle in der VRC über Bond Connect handelbaren Anleihen;
Geschäftstag	ein Tag, an dem die Märkte im Vereinigten Königreich geöffnet sind und/oder sonstige Tage, die der Verwaltungsrat gegebenenfalls festlegt und den Anteilinhabern im Voraus mitteilt;
CCASS	das Central Clearing and Settlement System der VRC;
CCDC	China Central Depository & Clearing Co., Ltd;
Zentralbank	die Central Bank of Ireland bzw. deren Abteilungen oder Nachfolgeorganisation;
OGAW-Vorschriften der Zentralbank	die Vorschriften des Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) von 2019 in ihrer jeweils aktuellen Fassung sowie alle jeweils von der Zentralbank ausgegebenen Regelungen oder Vorgaben;
CFETS	China Foreign Exchange Trading System (auch bekannt als das National Interbank Funding Centre);
Chinesische A-Aktien	Aktien von Unternehmen, die in der VRC gegründet wurden und an den Börsen Schanghai oder Shenzhen gehandelt und in RMB notiert

	werden;
China-Connect-Wertpapiere	Wertpapiere und/oder ETF, die an der SSE oder SZSE notiert sind und durch Anleger aus Hongkong und anderen Ländern unter Stock Connect gehandelt werden können;
CIBM	der China Inter Bank Bond Market;
CIBM Direct Access Programme(s)	Programm(e) für den Direktzugang gemäß der Ankündigung [2016] Nr. 3 der People's Bank of China, das den Direktzugang zum chinesischen Interbankenmarkt für Anleihen ermöglicht;
Klasse	Anteile eines bestimmten Fonds, die eine Beteiligung an dem Fonds repräsentieren, aber zwecks Zuordnung unterschiedlicher Anteile am Nettoinventarwert des betreffenden Fonds als eine Anteilsklasse innerhalb dieses Fonds bezeichnet werden, um die Möglichkeit unterschiedlicher Zeichnungs-, Umtausch- und Rücknahmegebühren, Dividendenarrangements, Basiswährungen, Währungsabsicherungsstrategien und/oder spezifischer Gebührenarrangements für diese Anteile zu schaffen;
CMU	Central Moneymarkets Unit der Hongkonger Bankenaufsicht HKMA;
CNH	der im Offshore-Markt der VRC gehandelte RMB;
CNY	der im Onshore-Markt der VRC gehandelte RMB;
Gesellschaft	SSGA SPDR ETFs Europe I plc;
CSDCC	China Securities Depository and Clearing Corporation Limited;
Die chinesische Wertpapieraufsichtsbehörde CSRC	China Securities Regulatory Commission;
Tagesquote	die tägliche Quote, der SHHK und SZHK unterliegen;
Datenschutzgesetze	(i) die Datenschutzgesetze von 1988 und 2003 sowie alle sonstigen Gesetze und Bestimmungen, mit denen die Richtlinie 95/46/EG umgesetzt wird, (ii) die European Communities (Electronic Communications Networks and Services) (Privacy and Electronic Communications) Regulations 2011, (iii) die Datenschutz-Grundverordnung (Verordnung (EU) 2016/679 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. April 2016) und daraus abgeleitete nationale Datenschutzgesetze und (iv) sämtliche Richtlinien und/oder Praxiskodizes, die vom irischen Datenschutzbeauftragten (Data Protection Commissioner) oder anderen zuständigen Aufsichtsbehörden, einschließlich des Europäischen Datenschutzausschusses, herausgegeben werden;
Handelstag	soweit im maßgeblichen Nachtrag nichts anderes festgelegt ist, für jeden Fonds jeder Geschäftstag (ausgenommen Tage, an denen ein Markt, an dem Wertpapiere, die im maßgeblichen Index enthalten sind, notiert sind oder gehandelt werden, geschlossen ist, und/oder der Tag vor einem solchen Tag; eine Liste dieser Schließungstage wird für jeden Fonds auf der Website veröffentlicht) und/oder weitere Tage, die der Verwaltungsrat gegebenenfalls festlegt und dem Administrator und den Anteilinhabern im Voraus mitteilt, wobei jeder Monat mindestens zwei Handelstage in regelmäßigen Abständen haben muss;
Delegierte Verordnung	Die Delegierte Verordnung (EU) 2016/438 der Kommission vom 17. Dezember 2015 zur Ergänzung der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates in Bezug auf die Pflichten der Verwahrstellen.
Verwahrstelle	State Street Custodial Services (Ireland) Limited oder eine andere jeweils gemäß den Anforderungen der Zentralbank von der Gesellschaft für die Erbringung von Verwahrdienstleistungen bestellte Gesellschaft;
Verwaltungsratsmitglieder	der jeweilige Verwaltungsrat der Gesellschaft sowie jeder

	ordnungsgemäß einberufene Ausschuss desselben;
Abgaben und Gebühren	alle Stempel- und sonstigen Abgaben, Behördengebühren, Abgaben, Umlagen, Umrechnungskosten und -provisionen (Devisenspreads inbegriffen), Verwahrstellen- und Unterdepotbankgebühren, Übertragungsgebühren und -kosten, Vermittlergebühren, Maklergebühren, Provisionen, Bankgebühren, Registrierungsgebühren und andere Abgaben und Gebühren, einschließlich Rückstellungen für den Spread oder die Differenz zwischen dem Preis, zu dem Vermögenswerte zwecks Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil eines Fonds bewertet wurden, und dem geschätzten oder tatsächlichen Preis, zu dem diese Vermögenswerte gekauft wurden oder gekauft werden sollen, bei Zeichnungen des betreffenden Fonds, oder verkauft wurden oder verkauft werden sollen, bei Rücknahmen des betreffenden Fonds, einschließlich – zur Klarstellung – sämtlicher Gebühren oder Kosten, die aus Anpassungen von Swaps oder anderen Derivatekontrakten resultieren, die aufgrund einer Zeichnung oder Rücknahme erforderlich waren, ob gezahlt, zahlbar oder entstanden oder die voraussichtlich gezahlt werden, zahlbar sind oder entstehen werden im Zusammenhang mit der Einrichtung, Erhöhung oder Reduzierung aller liquiden Mittel und sonstigen Vermögenswerte der Gesellschaft oder im Zusammenhang mit der Auflage, dem Erwerb, der Ausgabe, dem Umtausch, dem Tausch, dem Kauf, dem Halten, dem Rückkauf, der Rücknahme, dem Verkauf oder der Übertragung von Anteilen (einschließlich – wenn zutreffend – der Ausgabe oder Annullierung von Zertifikaten für Anteile) oder Anlagen von oder im Namen der Gesellschaft;
EWR	Europäischer Wirtschaftsraum;
Eingebettete Kosten	alle Kosten, die jedem Fonds indirekt durch seine Anlage in zugrunde liegenden Fonds entstehen (die zu marktüblichen Sätzen an den Anlageverwalter oder eine Konzerngesellschaft zahlbar sein können). Erwirbt ein Fonds Anteile anderer zugrunde liegender Fonds, die unmittelbar oder mittelbar durch eine Gesellschaft verwaltet werden, mit der der Anlageverwalter oder eine Konzerngesellschaft durch gemeinsame Verwaltung oder Kontrolle oder durch eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist, darf dieser Anlageverwalter oder diese Konzerngesellschaft keine Zeichnungs- oder Rücknahmegebühren aufgrund der Anlage des Fonds in die Anteile dieser anderen zugrunde liegenden Fonds erheben;
ESG-Filter	ein von einem Indexanbieter und/oder dem Anlageverwalter umgesetzter Filter, der die Ermittlung und den Ausschluss bestimmter potenzieller Komponenten in Bezug auf Verstöße gegen bestimmte ökologische, soziale oder Unternehmensführungskriterien zum Ziel hat;
ETF-Anteile	ein Anteil oder Anteile einer börsengehandelten Klasse am Kapital der Gesellschaft (außer Zeichneranteilen), die den Inhabern einen Anspruch auf Beteiligung an den Gewinnen der Gesellschaft, die dem jeweiligen Fonds zuzuordnen sind, verleihen, wie in diesem Prospekt beschrieben;
EU	Europäische Union;
EUR oder Euro	die Einheitswährung der teilnehmenden Mitgliedstaaten der Europäischen Währungsunion, die am 1. Januar 1999 eingeführt wurde;
FATCA	bezeichnet die Vorschriften, die allgemein bekannt sind als der Foreign Accounts Tax Compliance Act in der in den Vereinigten Staaten von Amerika verabschiedeten Form, bekannt als Hiring Incentives to Restore Employment Act 2010;
Fester Portfolio-Korb	ein Korb aus Wertpapieren und einer Barkomponente, der vom Anlageverwalter so festgelegt wird, dass er sich eng an der Zusammensetzung des jeweiligen Fonds orientiert (so dass der

	Anlageverwalter nach Abschluss der Zeichnung keine weiteren wesentlichen Schritte in Form von zusätzlichen Käufen oder Verkäufen von Wertpapieren oder Anpassungen anderer Positionen, die im jeweiligen Fonds gehalten werden, vornehmen muss, um die Zusammensetzung des Fonds neu auszurichten);
Fonds	ein Portfolio aus Vermögenswerten, das (mit Zustimmung der Verwahrstelle und der Zentralbank) vom Verwaltungsrat festgelegt wird und einen separaten Fonds bildet, der durch separate Serien von Anteilen repräsentiert wird und gemäß dem Anlageziel und der Anlagepolitik des betreffenden Fonds investiert wird;
Globaler Nachtrag	der Nachtrag mit dem Titel „Globaler Nachtrag“ wird zusammen mit dem Prospekt veröffentlicht und enthält eine Aufstellung der aktuellen Fonds der Gesellschaft;
HKEx	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited;
HKMA	Hong Kong Monetary Authority;
HKSCC	Hong Kong Securities Clearing Company Limited;
Index	jeder Finanzindex, den ein Fonds gemäß seinem Anlageziel und/oder seiner Anlagepolitik, wie im maßgeblichen Nachtrag beschrieben, nachzubilden versucht;
Indexanbieter	in Bezug auf einen Fonds die Stelle oder Person, die selbst oder über einen beauftragten Vertreter Informationen über einen Index zusammenstellt, berechnet und veröffentlicht, wie im maßgeblichen Nachtrag beschrieben;
Indexwertpapiere	Wertpapiere, die in einem Index geführt werden;
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited oder eine andere jeweils gemäß den Anforderungen der Zentralbank von der Gesellschaft mit der Erbringung von Anlageverwaltungsdienstleistungen beauftragte Gesellschaft. Zur Klarstellung wird festgehalten, dass der Begriff „Anlageverwalter“ auch - sofern der Gesamtzusammenhang dies zulässt - Unteranlageverwalter, die bisweilen vom Anlageverwalter gemäß seiner Befugnis unter dem Verwaltungsvertrag eingesetzt werden, umfasst;
Wertpapierbörse	die ausgewählten Börsen, die der Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit für die einzelnen Fonds festlegt, und die auf der Website aufgeführt sind;
Verwaltungsgesellschaft	State Street Global Advisors Europe Limited oder eine andere jeweils gemäß den Anforderungen der Zentralbank von dem Fonds mit der Erbringung von Dienstleistungen als Verwaltungsgesellschaft beauftragte Gesellschaft;
Mitgliedstaat	ein Mitgliedstaat der Europäischen Union;
Mindestrücknahmebetrag	die vom Verwaltungsrat oder von ordnungsgemäß bevollmächtigten Vertretern für den jeweiligen Fonds festgelegte und im maßgeblichen Nachtrag oder in den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer aufgeführte Mindestmenge für Rücknahmen eines Fonds oder an einem Handelstag; diese kann als Geldbetrag oder als Anzahl von Anteilen angegeben sein;
Mindestzeichnungsbetrag	die vom Verwaltungsrat oder von ordnungsgemäß bevollmächtigten Vertretern für den jeweiligen Fonds festgelegte und im maßgeblichen Nachtrag oder in den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer aufgeführte Mindestmenge für Anteilszeichnungen an einem Handelstag; diese kann als Geldbetrag oder als Anzahl von Anteilen angegeben sein;
Geldmarktfonds	Ein Organismus für gemeinsame Anlagen, der als Geldmarktfonds im Sinne der Verordnung (EU) 2017/1131 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 14. Juni 2017 über Geldmarktfonds qualifiziert ist.

Ausgehandelter Portfolio-Korb	ein Korb von Wertpapieren, auf die sich der Anleger und der Anlageverwalter aus einer vom Anlageverwalter als für die Umsetzung des Anlageziels des Fonds geeignet identifizierten Liste geeinigt haben (wobei dieser jedoch vom Anlageverwalter verlangen kann, dass er weitere Schritte in Form von zusätzlichen Käufen oder Verkauf von Wertpapieren oder Anpassungen anderer in Bezug auf den betreffenden Fonds gehaltener Positionen vornimmt, um die Zusammensetzung des Fonds neu auszurichten), plus einer Barkomponente;
Nettoinventarwert	der Nettoinventarwert eines Fonds, berechnet, wie im Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ in diesem Prospekt beschrieben;
Nettoinventarwert je Anteil	der Nettoinventarwert eines Anteils eines Fonds, einschließlich eines Anteils jeder in einem Fonds aufgelegten Anteilsklasse, berechnet wie im Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ in diesem Prospekt beschrieben;
Nicht-ETF-Anteile	ein Anteil oder Anteile am Kapital der Gesellschaft (mit Ausnahme der ETF-Anteile und der Zeichneranteile), die ihrem jeweiligen Halter einen Anspruch an einer Beteiligung an den Gewinnen der Gesellschaft, die, wie in diesem Prospekt beschrieben, dem jeweiligen Fonds zuzuschreiben ist, gewähren;
OECD	die Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung;
PBoC	die People's Bank of China;
VRC	die Volksrepublik China (wobei je nach Kontext und im Sinne dieses Prospekts und seiner zugehörigen Dokumente Verweise auf die VRC oder „China“ Hongkong, Macau und Taiwan nicht einschließen);
Anlagen in der VRC	Anlagen, die ein Engagement in (i) Emittenten aus der VRC oder anderen Emittenten, die zu Großchina gehören, wie Hongkong, Macau oder Taiwan, begründen und/oder in (ii) Emittenten, die an Freiverkehrsmärkten innerhalb und außerhalb von Großchina, wie z. B. im Vereinigten Königreich, Singapur, Japan oder den Vereinigten Staaten, notiert sein oder gehandelt werden können;
In der VRC notiertes Unternehmen	ein in der VRC gegründetes Unternehmen, das an einer Börse auf dem chinesischen Festland notiert ist;
VRC-Unterdepotbank	HSBC Bank (China) Company Limited oder jedes andere Unternehmen, das als Unterdepotbank und Handels- und Abwicklungsvertreter für den Anleihenhandel am Interbankenmarkt für die betreffenden Fonds zum Zwecke der über das bzw. die CIBM Direct Access Programme(s) und/oder die QFI getätigten Anlagen benannt wurde;
Datenschutzerklärung	die von der Gesellschaft abgegebene Datenschutzerklärung in ihrer jeweils gültigen Fassung. Die aktuelle Version wird dem Antragsformular beigelegt und ist über die Website abrufbar;
Prospekt	dieses Dokument, der maßgeblichen Nachtrag für einen Fonds sowie alle weiteren Nachträge oder Ergänzungen, die dafür vorgesehen sind, zusammen mit diesem Dokument gelesen und ausgelegt zu werden, und die Bestandteil dieses Dokuments sind;
QFI	Qualified Foreign Investor (qualifizierter ausländischer Anleger) gemäß den Anlagevorschriften;
Anerkannter Markt	jede anerkannte Börse und jeder anerkannte Markt, die bzw. der in Anhang II dieses Prospekts aufgeführt ist, sowie alle sonstigen Märkte, die der Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit gemäß den OGAW-Vorschriften festlegt und die in Anhang II dieses Prospekts aufgeführt sind;
Anerkannte Rating-Agentur	Standard & Poor's Rating Group („ S&P “), Moody's Investors Services („ Moody's “), Fitch IBCA oder eine äquivalente Ratingagentur;

Registerstelle	der Administrator oder (eine) andere jeweils gemäß den Anforderungen der Zentralbank zur Erbringung von Registrierungsdienstleistungen beauftragte Gesellschaft(en);
Maßgebliches Institut	(a) ein im EWR (Mitgliedstaaten der Europäischen Union, Norwegen, Island, Liechtenstein) zugelassenes Kreditinstitut; (b) ein in einem Unterzeichnerstaat (außer den EWR-Mitgliedsstaaten) des Basler Kapitalkonvergenzabkommens vom Juli 1988 (Schweiz, Kanada, Japan, Vereinigtes Königreich und Vereinigte Staaten) zugelassenes Kreditinstitut; oder (c) ein Kreditinstitut, das in einem Drittland zugelassen ist, das gemäß Artikel 107(4) der Verordnung (EU) 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012;
Maßgeblicher Nachtrag	ein Dokument, das Informationen zu den einzelnen Fonds enthält;
RMB	der Renminbi, die offizielle Währung der VRC;
RMP-Erklärung	eine von der Verwaltungsgesellschaft in Bezug auf die Gesellschaft jeweils in Einklang mit den Anforderungen der Zentralbank abgegebene Erklärung zum Risikomanagementprozess;
SAFE	die State Administration of Foreign Exchange (Staatliche Devisenverwaltung) der VRC;
Saudische Corporate-Governance-Vorschriften oder CGR	die vom Direktorium der Kapitalmarktaufsichtsbehörde gemäß Beschluss Nr. 8-16-2017 vom 16.05.1438 Hijri (entspricht dem 13.02.2017 nach gregorianischem Kalender) herausgegebenen Vorschriften (in ihrer jeweils gültigen Fassung) auf Basis des Kapitalmarktgesetzes, herausgegeben per königliches Dekret Nr. M/30 vom 02.06.1424 Hijri.
Die saudischen FIS-Vorschriften	die vom Direktorium der Kapitalmarktaufsichtsbehörde gemäß Beschluss Nr. 2-26-2023 am 05.09.1444 Hijri (entspricht dem 27.03.2023 nach gregorianischem Kalender) herausgegebenen Vorschriften auf Basis des Kapitalmarktgesetzes, herausgegeben per königliches Dekret Nr. M/30 vom 02.06.1424 Hijri.
Instruktionen für saudische Anlagedepots	die vom Direktorium der Kapitalmarktaufsichtsbehörde gemäß Beschluss Nr. 4-39-2016 vom 26/06/1437 Hijri (entspricht dem 3.04.2016 nach gregorianischem Kalender) herausgegebenen Vorschriften auf Basis des Kapitalmarktgesetzes, herausgegeben per königliches Dekret Nr. M/30 vom 02.06.1424 Hijri.
Saudi-Qualified Foreign Investor oder Saudi QFI	gemäß den saudischen FIS-Vorschriften die jeweiligen Fonds, die die in den saudischen FIS-Vorschriften festgelegten Qualifikationskriterien erfüllen und direkt in an der Saudi Stock Exchange notierte Aktien investiert haben und als Saudi QFIs Anlagedepots gemäß den Instruktionen für saudische Anlagedepots eröffnet haben.
SC-Wertpapiere	China-Connect-Wertpapiere, in die über Stock Connect (siehe nachstehende Definition) investiert wird;
SEHK	Stock Exchange of Hong Kong Limited;
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel 8 der SFDR – bezeichnet ein Finanzprodukt, das unter anderem ökologische oder soziale Merkmale oder eine Kombination dieser Merkmale fördert; Artikel 9 der SFDR – bezeichnet ein Finanzprodukt, das nachhaltige Anlagen zu seinem Ziel hat;
SFO	die Securities and Futures Ordinance (Wertpapier- und Futures-Verordnung) der VRC;
Anteil oder Anteile	ein Anteil oder Anteile (einschließlich ETF-Anteile und Nicht-ETF-Anteile) jedweder Klasse am Kapital der Gesellschaft (mit Ausnahme

	der Zeichneranleihen), die ihrem jeweiligen Halter den Anspruch gewähren an den Gewinnen der Gesellschaft, die, wie in diesem Prospekt beschrieben, dem jeweiligen Fonds zuzuschreiben sind, zu partizipieren;
Anteilinhaber	eine Person, die im Gesellschafterregister der Gesellschaft als Inhaber von Anteilen registriert ist;
SHCH	Shanghai Clearing House;
SHHK	Shanghai-Hong Kong Stock Connect;
SPSA	ein separates Sonderkonto bei CCASS, auf dem Positionen in SC-Wertpapieren gehalten werden;
SSE	Shanghai Stock Exchange;
SSIM	State Street Investment Management, der Anlageverwaltungsweig der State Street Corporation;
Stock Connect	Shanghai-Hong Kong Stock Connect und/oder Shenzhen-Hong Kong Stock Connect;
Großaktionär	ein Aktionär, der 5 % oder mehr aller ausgegebenen Aktien hält, wobei seine Positionen mit anderen Konzernunternehmen des in der VRC notierten Unternehmens zusammengerechnet werden;
Unteranlageverwalter	bedeutet eine für einen Fonds zum Unteranlageverwalter ernannte Stelle wie im maßgeblichen Nachtrag oder in den regelmäßigen Berichten der Gesellschaft angegeben, insbesondere State Street Global Advisors Trust Company, State Street Global Advisors Limited und State Street Global Advisors Singapore Limited, die jeweils über die uneingeschränkte Befugnis und Entscheidungsvollmacht im Namen und für Rechnung der Gesellschaft zur Verwaltung und Investition von liquiden Mitteln und sonstigen Vermögenswerten des jeweiligen Fonds oder eines Teils der liquiden Mittel und sonstigen Vermögenswerte des jeweiligen Fonds verfügen, wie die Parteien jeweils schriftlich vereinbaren können;
Zeichneranteile	die zwei (2) nennwertlosen Zeichneranteile, die für jeweils 1,00 EUR ausgegeben und vom Anlageverwalter und/oder dessen Nominees gehalten werden;
Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“)	bezeichnet die Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor;
Nachhaltigkeitsrisiko	ist ein ökologisches, soziales oder Unternehmensführungsereignis oder ein Zustand, das bzw. der beim Eintreten tatsächlich oder potenziell wesentliche negative Auswirkungen auf den Wert der Anlage haben könnte;
SZSE	Shenzhen Stock Exchange;
SZHK	Shenzhen-Hong Kong Stock Connect;
Tadawul	die saudische Börse (Saudi Stock Exchange)
Taxonomie-Verordnung	bezeichnet die Verordnung (EU) 2020/852 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 18. Juni 2020 über die Schaffung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Anlagen und zur Änderung der Verordnung (EU) 2019/2088, in ihrer jeweils gültigen Fassung;
OGAW	ein Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren im Sinne der OGAW-Vorschriften;
OGAW-Richtlinie	bedeutet Richtlinie 2014/91/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 zur Änderung der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend

	bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) im Hinblick auf die Aufgaben der Verwahrstelle, die Vergütungspolitik und Sanktionen, einschließlich ihre zwingend vorgeschriebenen Durchführungsverordnungen;
OGAW-Vorschriften	die Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 (Durchführungsverordnung Nr. 352 von 2011) und alle anwendbaren Mitteilungen der Zentralbank oder darunter auferlegten Bedingungen oder gewährten Befreiungen;
Zugrunde liegender Fonds	eine gemeinsame Anlage oder ein Dachorganismus („Umbrella“) für gemeinsame Anlagen, der nach der OGAW-Richtlinie in der Europäischen Union autorisiert ist oder ein Nicht-OGAW, der gemäß den Erfordernissen der Zentralbank zu Portfolioanlagen berechtigt ist. Solche berechtigten Nicht-OGAW sind laut den von der Zentralbank herausgegebenen OGAW-Vorschriften der Zentralbank (i) Vehikel, die in Guernsey errichtet wurden und als Vehikel der Klasse A zugelassen sind, (ii) Vehikel, die in Jersey als „Recognised Funds“ errichtet wurden, (iii) Vehikel, die auf der Isle of Man als „Authorised Schemes“ errichtet wurden, (iv) regulierte Nicht-OGAW-Retail-OGA, die von der Zentralbank zugelassen wurden, unter der Voraussetzung, dass diese OGA alle wesentlichen Aspekte der Bestimmungen der OGAW-Vorschriften der Zentralbank erfüllen, und (v) regulierte Nicht-OGAW-OGA, die in einem Mitgliedstaat des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, in Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und alle wesentlichen Aspekte der Bestimmungen der OGAW-Vorschriften der Zentralbank erfüllen. Die Erwägung von „alle wesentliche Aspekte“ umfasst unter anderem die Erwägung der folgenden Punkte: (a) die Existenz eines unabhängigen Treuhänders/Verwahrstelle mit ähnlichen Pflichten und Verantwortlichkeiten in Hinsicht auf die sichere Verwahrung und Beaufsichtigung, (b) die Anforderungen zur Streuung des Anlagerisikos, einschließlich Konzentrationslimits, Besitzbeschränkungen, Beschränkungen in Hinsicht auf Fremdfinanzierungen und Leihgeschäfte usw., (c) die Verfügbarkeit von Kosteninformationen und Berichterstattungspflichten, (d) Vorkehrungen für die Rückgabe von Anteilen und deren Frequenz und (e) Beschränkungen in Hinsicht auf Geschäfte verbundener Parteien;
„US“ und „Vereinigte Staaten“	bedeutet die Vereinigten Staaten von Amerika oder ihre Territorien, Besitztümer, alle Staaten der Vereinigten Staaten von Amerika und den District of Columbia;
US-Person	eine „ US-Person “ gemäß Definition in Regulation S des Securities Act von 1933 in ihrer jeweils gültigen Fassung;
Bewertungszeitpunkt	der für jeden Fonds im maßgeblichen Nachtrag festgelegte Zeitpunkt oder andere Zeitpunkte, die die Verwaltungsgesellschaft von Zeit zu Zeit festlegt und den Anteilinhabern mitteilt. Zur Klarstellung wird festgehalten, dass der Zeitpunkt, zu dem der Nettoinventarwert ermittelt wird, immer nach dem jeweiligen Orderannahmeschluss liegt;
Website	www.ssga.com; hier werden der Nettoinventarwert je Anteil, die Portfoliopositionen und sonstige relevante Informationen zu einem Fonds veröffentlicht und können dieser Prospekt und sonstige Informationen über die Gesellschaft, einschließlich diverser Mitteilungen an die Anteilinhaber, veröffentlicht werden.

Anhang II – Anerkannte Märkte

- (i) **Jede Börse und jeder Markt in einem EU-Mitgliedstaat (außer Malta) oder in einem der folgenden OECD-Mitgliedstaaten:**

Australien, Kanada, Island, Japan, Neuseeland, Norwegen, der Schweiz, Vereinigten Königreich oder in den USA.

- (ii) **Jede(r) der folgenden Börsen oder Märkte:**

Argentinien	Bolsa de Comercio de Buenos Aires
	Cordoba Stock Exchange
	La Plata Stock Exchange
	Mercado Argentino de Valores S.A.
	Mercado Abierto Electronico S.A.
Bangladesh	Mercado A Termino de Buenos Aires S.A.
	Chittagong Stock Exchange
	Dhaka Stock Exchange
Bahrain	Bahrain Bourse
Brasilien	BM&F Bovespa S.A. (B3 S.A.)
Chile	Santiago Stock Exchange
	La Bolsa Electronica de Chile
China	Shanghai Stock Exchange
	Shenzhen Stock Exchange
	China Inter Bank Bond Market
Kolumbien	Bolsa de Valores de Colombia
Ägypten	Egyptian Exchange
Hongkong	Stock Exchange of Hong Kong
	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.
Indien	National Stock Exchange of India Limited
	Bombay Stock Exchange
	MCX Stock Exchange (MCX-SX)
	MCX Stock Exchange (MCX-SX)
	Multi Commodity Exchange (MCX)
	National Commodity and Derivatives Exchange

Indonesien	Börse Indonesia
Israel	Börse Tel Aviv
Jordanien	Börse Amman
Kasachstan	Central Asian Stock Exchange Kazakhstan Stock Exchange
Kenia	Börse Nairobi
Korea	Korea Exchange
Kuwait	Börse Kuwait
Malaysia	Bursa Malaysia Berhad
Mauritius	Börse Mauritius
Mexiko	Mexico Stock Exchange
Marokko	Casablanca Stock Exchange
Nigeria	Nigeria Stock Exchange
Oman	Muscat Stock Exchange
Pakistan	Pakistan Stock Exchange Limited Pakistan Mercantile Exchange
Peru	Lima Stock Exchange
Philippinen	Börse Philippinen
Katar	Qatar Exchange
Argentinien	Saudi Stock Exchange/Tadawul
Serbien	Belgrade Stock Exchange
Singapur	Singapore Exchange Limited
Südafrika	JSE Limited Südafrikanische Futures-Börse
Taiwan	Taiwan Stock Exchange Corporation Gretai Securities Market
Thailand	Stock Exchange of Thailand Bond Electronic Exchange
Tunesien	Bourse des Valeurs Mobilières de Tunis

Türkei	Borsa Istanbul
Ukraine	PFTS Ukraine Stock Exchange
Vereinigte Arabische Emirate	Abu Dhabi Stock Exchange Dubai Financial Market NASDAQ Dubai Limited
Vietnam	Ho Chi Minh Stock Exchange Hanoi Stock Exchange

(iii)

Die folgenden Märkte:

- die von der International Capital Markets Association organisierten Märkte;
- der britische (i) von Banken und anderen Institutionen betriebene, durch die britische Finanzaufsichtsbehörde (Financial Conduct Authority, „FCA“) geregelte Markt, der den Inter-Professional Conduct-Bestimmungen des Market Conduct Sourcebook der FCA unterliegt, und (ii) der Markt für Non-Investment Products, der den im „**Non-Investment Product Code**“ enthaltenen Vorgaben unterliegt, die von Teilnehmern des Londoner Markts aufgestellt wurden, darunter auch die FCA und die Bank of England (ehemals „**The Grey Paper**“);
- (a) NASDAQ in den Vereinigten Staaten, (b) der Markt für US-Staatspapiere, der von Primärhändlern betrieben und von der Federal Reserve Bank of New York reguliert wird; (c) der Freiverkehrsmarkt in den Vereinigten Staaten, der von Primär- und Sekundärhändlern betrieben und durch die US-Wertpapier- und Börsenaufsichtsbehörde (SEC) sowie die National Association of Securities Dealers reguliert wird (und durch Bankinstitute, die durch den US Comptroller of the Currency, die Federal Reserve System oder Federal Deposit Insurance Corporation reguliert werden);
- (a) NASDAQ Japan, (b) der Freiverkehrsmarkt in Japan, der von der Securities Dealers Association of Japan reguliert wird, und (c) der Market of the High-Growth and Emerging Stocks („**MOTHERS**“)
- der Alternative Investment Market im Vereinigten Königreich, der von der Londoner Börse reguliert und betrieben wird;
- der Hong Kong Growth Enterprise Market („**GEM**“);
- die Stock Exchange of Singapore Dealing and Automated Quotation (SESDAQ)
- die Korean Securities Dealers Automated Quotation („**KOSDAQ**“)
- der französische Markt für Titres de Creance Negotiable (Freiverkehrsmarkt für handelbare Schuldtitel);
- der Freiverkehrsmarkt für kanadische Staatsanleihen, der von der Investment Dealers Association of Canada reguliert wird;
- EASDAQ (European Association of Securities Dealers Automated Quotation)

(iv) in Bezug auf derivative Finanzinstrumente (DFI) folgende Märkte:

Amerika:

Nasdaq, Chicago Mercantile Exchange (CME) (im Besitz der CME Group), Chicago Board of Trade (CBOT) (im Besitz der CME Group), Chicago Board Options Exchange, ICE Futures US (ICE), Montreal Exchange (MX), Mexican Derivatives Exchange (MexDer), ROFEX (Rosario Futures Exchange), BM&F Bovespa

Asien:

China Financial Futures Exchange (CFFEX), China Interbank Bond Market (CIBM), Hong Kong Futures Exchange (HKFE) — zur Hong Kong Exchanges and Clearing (HKEx) gehörend, Bombay Stock Exchange (BSE), Metropolitan Stock Exchange of India Ltd., National Stock Exchange of India (NSE), Bursa Malaysia Derivatives Berhad, Tokyo Financial Exchange (TFX), Tokyo Stock Exchange, Taiwan Futures Exchange (TAIFEX), Thailand Futures Exchange (TFEX), Singapore Exchange (SGX), Osaka Securities Exchange (OSE), Korea Exchange (KRX) Pakistan Stock Exchange, Eurex Asia

Australasien:

ASX, NZX Derivatives Europe:

Athens Derivative Exchange, IDEM, Borsa Istanbul, Budapest Stock Exchange (BSE), Eurex Deutschland, Eurex Zurich, Euronext Derivatives Amsterdam, Euronext Derivatives Brussels, Euronext Derivatives Paris, Euronext Derivatives Lisbon, ICE Futures Europe, MEFF Exchange, Moscow Exchange, Nasdaq Copenhagen, Nasdaq Stockholm, Nasdaq Oslo, Nasdaq Helsinki, Ukrainian Exchange (UX), Oslo Bors, Warsaw Stock Exchange, London Stock Exchange — Derivatives Market, Euronext EQF

Afrika/Nahost:

Johannesburg Stock Exchange („JSE“) — Equity Derivatives Market, Dubai Gold & Commodities Exchange, NASDAQ Dubai

Anhang III – Unterdepotbanken

Die Verwahrstelle hat zum Datum dieses Prospekts lokale Unterdepotbanken im Rahmen des State Street Global Custody Network wie nachstehend aufgeführt bestellt. Die aktuellste Fassung dieser Liste ist auf der Website einzusehen.

Markt	Unterdepotbank
Albanien	Raiffeisen Bank sh.a.
Argentinien	Citibank, N.A.
Australien	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
Österreich	UniCredit Bank Austria AG
Bahrain	First Abu Dhabi Bank P.J.S.C.
Bangladesch	Standard Chartered Bank
Belgien	Deutsche Bank AG, Niederlande (tätig durch ihre Niederlassung in Amsterdam mit Unterstützung der Zweigstelle in Brüssel)
Benin	über Standard Chartered Bank Côte d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Bermuda	HSBC Bank Bermuda Limited
Föderation Bosnien und Herzegowina	UniCredit Bank d.d.
Botswana	Standard Chartered Bank Botswana Limited
Brasilien	Citibank, N.A.
Bulgarien	Citibank Europe plc, Bulgaria Branch
Burkina Faso	über Standard Chartered Bank Côte d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Kanada	State Street Trust Company Kanada
Chile	Banco de Chile
Volksrepublik China	HSBC Bank (China) Company Limited China Construction Bank Corporation
China Connect	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
Kolumbien	Cititrust Colombia S.A. Sociedad Fiduciaria
Costa Rica	Banco BCT S.A.
Kroatien	Privredna Banka Zagreb d.d. Zagrebacka Banka d.d.
Zypern	BNP Paribas S.A., Griechenland (tätig durch ihre Zweigstelle in Athen)
Tschechische Republik	UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s.
Dänemark	Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ), Sweden
Ägypten	First Abu Dhabi Bank Misr (als Vertreter der First Abu Dhabi Bank P.J.S.C.)
Estland	AS SEB Pank
Finnland	Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ), Sweden (tätig durch ihre Zweigstelle in Helsinki)
Frankreich	Deutsche Bank AG, Niederlande (tätig durch ihre Niederlassung in Amsterdam mit Unterstützung

Markt	Unterdepotbank
	der Zweigstelle in Paris)
Republik Georgien	JSC Bank of Georgia
Deutschland	State Street Bank International GmbH
	Deutsche Bank AG
Ghana	Standard Chartered Bank Ghana Plc
Griechenland	BNP Paribas S.A.
Guinea-Bissau	über Standard Chartered Bank Côte d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Hongkong	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
Ungarn	Citibank Europe plc Magyarországi Fióktelepe
	UniCredit Bank Hungary Zrt.
Island	Landsbankinn hf.
Indien	Deutsche Bank AG
	Citibank, N.A.
	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
Indonesien	Deutsche Bank AG
Irland	State Street ist ein direkter Teilnehmer der Euroclear Bank S.A./N.V.
	Euroclear Bank S.A./N.V., als der Zentralverwahrer für Aktien und Unternehmensanleihen mit Domizil in Irland und irische Staatsanleihen, verwahrt diese Vermögenswerte und leistet alle Verwahrdienstleistungen dafür.
Israel	Bank Hapoalim B.M.
Italien	Intesa Sanpaolo S.p.A.
Elfenbeinküste	Standard Chartered Bank Côte d'Ivoire S.A.
Japan	Mizuho Bank, Limited
Jordanien	Standard Chartered Bank, Niederlassung im Internationalen Finanzzentrum Dubai
Kasachstan	JSC Citibank Kazakhstan
Kenia	Standard Chartered Bank Kenya Limited
Republik Korea	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	Deutsche Bank AG
Kuwait	First Abu Dhabi Bank P.J.S.C.
Lettland	AS SEB banka
Litauen	AB SEB bankas
Luxemburg	State Street ist ein direkter Teilnehmer der Clearstream Banking S.A., Luxemburg.
	In Luxemburg ansässige Vermögenswerte können bei jeder der folgenden ICSD gehalten werden: Clearstream Banking S.A., Luxemburg oder Euroclear Bank S.A./N.V.
Malawi	Standard Bank PLC
Malaysia	Deutsche Bank (Malaysia) Berhad
Mali	über Standard Chartered Bank Côte d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste

Markt	Unterdepotbank
Mauritius	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
Mexiko	Banco Citi México, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Citi México
Marokko	Citibank Maghreb S.A.
Namibia	Standard Bank Namibia Limited
Niederlande	Deutsche Bank AG
Neuseeland	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
Niger	über Standard Chartered Bank Côte d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Nigeria	Stanbic IBTC Bank Plc.
Norwegen	Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ), Schweden (tätig durch ihre Zweigstelle in Oslo)
Oman	First Abu Dhabi Bank P.J.S.C.
Pakistan	Deutsche Bank AG
Panama	Citibank, N.A.
Peru	Citibank del Perú, S.A.
Philippinen	Deutsche Bank AG
Polen	Bank Handlowy w Warszawie S.A.
Portugal	Citibank Europe plc, Dublin, Irland
Katar	HSBC Bank Middle East Limited
Rumänien	Citibank Europe plc, Dublin – Zweigstelle Rumänien
Russland	AO Citibank
Saudi-Arabien	FAB Capital J.S.C.
Senegal	über Standard Chartered Bank Côte d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Serbien	UniCredit Bank Serbia JSC Belgrade
Singapur	Citibank N.A.
Slowakische Republik	UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s.
Slowenien	UniCredit Banka Slovenija d.d.
Südafrika	FirstRand Bank Limited Standard Chartered Bank
Spanien	Citibank Europe plc, Dublin, Irland
Sri Lanka	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
Republika Srpska	UniCredit Bank d.d.
Schweden	Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ)
Schweiz	UBS Switzerland AG
Taiwan - R.O.C.	Deutsche Bank AG
Tansania	Standard Chartered Bank (Tanzania) Limited
Thailand	Standard Chartered Bank (Thai) Public Company Limited
Togo	über Standard Chartered Bank Côte d'Ivoire S.A., Abidjan, Elfenbeinküste
Tunesien	Union Internationale de Banques

Markt	Unterdepotbank
Türkei	Citibank, A.Ş.
Uganda	Standard Chartered Bank Uganda Limited
Ukraine	JSC Citibank
Vereinigte Arabische Emirate Dubai Financial Market	First Abu Dhabi Bank P.J.S.C.
Vereinigte Arabische Emirate Dubai International Financial Center	First Abu Dhabi Bank P.J.S.C.
Vereinigte Arabische Emirate Abu Dhabi	First Abu Dhabi Bank P.J.S.C.
Vereinigtes Königreich	State Street Bank and Trust Company, United Kingdom branch
Vereinigte Staaten	State Street Bank and Trust Company
Uruguay	Banco Itaú Uruguay S.A.
Vietnam	HSBC Bank (Vietnam) Limited
Sambia	Standard Chartered Bank Zambia Plc.
Zimbabwe	Stanbic Bank Zimbabwe Limited
Transnationale Verwahrstellen	Euroclear Bank S.A./N.V.
	Clearstream Banking, S.A.

SSGA SPDR ETFs Europe I plc

(die „Gesellschaft“)

Ergänzung vom 21. Mai 2026 zum Prospekt der Gesellschaft vom 19. Februar 2026 (die „Ergänzung“)

Diese Ergänzung ist Teil des Prospekts der Gesellschaft vom 19. Februar 2026 (der „**Prospekt**“) und ist in Verbindung mit diesem zu lesen. Sie ersetzt die Ergänzung vom 13. Mai 2026. Alle im Prospekt und im Prospektnachtrag enthaltenen Informationen gelten als in diese Ergänzung einbezogen.

Die Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft (die „**Verwaltungsratsmitglieder**“), übernehmen die Verantwortung für die in dieser Ergänzung enthaltenen Informationen. Nach bestem Wissen und Gewissen der Verwaltungsratsmitglieder (die alle angemessene Sorgfalt darauf verwendet haben, dies sicherzustellen) stimmen die in dieser Ergänzung enthaltenen Angaben mit den Tatsachen überein und lassen nichts aus, was die Bedeutung der Angaben beeinträchtigen könnte. Die Verwaltungsratsmitglieder übernehmen dementsprechend die Verantwortung.

Begriffe und Ausdrücke, die hier nicht eigens definiert sind, haben dieselbe Bedeutung, die ihnen im Prospekt und den Nachträgen zugeschrieben wird.

Änderungen am Prospekt

1. Der Unterabschnitt des Prospekts mit der Überschrift „*Primärmarkt*“ im Abschnitt „*Kauf und Verkaufsinformationen*“ wird durch die Aufnahme des nachstehenden Absatzes nach dem Absatz „*Abgaben und Gebühren für Zeichnungen in Sachwerten*“ aktualisiert:

„Verwässerungsabgabe für Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung und Sachwerte. Soweit für das Liquiditätsmanagement erforderlich, kann der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen an jedem Handelstag, an dem Nettozeichnungen oder -rücknahmen stattfinden, eine angemessene Rückstellung für eine Verwässerungsabgabe bilden. Wenn eine Verwässerungsabgabe erhoben wird, fallen für die betreffende Zeichnung oder Rücknahme keine Abgaben und Gebühren an. Bei Erhebung einer Verwässerungsabgabe sind Verweise auf die Anwendung von „Abgaben und Gebühren“ im gesamten Prospekt auch als Verweise auf eine Verwässerungsabgabe zu verstehen.“

2. Der Unterabschnitt im Prospekt mit der Überschrift „*Vorübergehende Aussetzung des Handels*“ im Abschnitt „*Ermittlung des Nettoinventarwerts*“ wird vollständig gestrichen und durch folgenden Wortlaut ersetzt:

„Vorübergehende Aussetzung des Handels. In den folgenden Fällen kann der Verwaltungsrat die Bewertung oder Ausgabe, den Verkauf, den Kauf, die Rücknahme und den Umtausch von Anteilen eines Fonds oder die Zahlung von Rücknahmeerlösen jederzeit nach vorheriger Mitteilung an die Verwahrstelle vorübergehend aussetzen:

- a) während eines Zeitraums, in dem ein anerkannter Markt, an dem ein wesentlicher Teil der von der Gesellschaft jeweils gehaltenen Anlagen notiert, gelistet oder gehandelt wird, außer aufgrund gesetzlicher Feiertage geschlossen ist oder in dem der Handel an einem solchen anerkannten Markt eingeschränkt ist oder ausgesetzt wird;
- b) während eines Zeitraums, in dem infolge politischer, militärischer, wirtschaftlicher oder währungspolitischer Ereignisse oder anderer Umstände, die außerhalb des Einflussbereiches des Verwaltungsrats liegen und nicht von diesem zu verantworten sind, die Veräußerung oder Bewertung von jeweils von der Gesellschaft gehaltenen Anlagen nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht auf die übliche Weise und nicht ohne

Beeinträchtigung der Interessen der Anteilinhaber erfolgen oder abgeschlossen werden können;

- c) während eines Ausfalls der Kommunikationseinrichtungen, die üblicherweise zur Ermittlung des Werts der jeweils von der Gesellschaft gehaltenen Anlagen eingesetzt werden, oder während eines Zeitraums, in dem aus einem anderen Grund der Wert der jeweils von der Gesellschaft gehaltenen Anlagen nach Auffassung des Verwaltungsrats nicht unverzüglich oder eindeutig bestimmt werden kann;
- d) während eines Zeitraums, in dem die Gesellschaft nicht in der Lage ist, Gelder zur Leistung von Rücknahmezahlungen zu repatriieren, oder in dem die Veräußerung von jeweils von der Gesellschaft gehaltenen Anlagen oder die Übertragung oder Zahlung von in diesem Zusammenhang benötigten Geldern nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht zu üblichen Preisen bzw. üblichen Wechselkursen getätigt werden kann;
- e) während eines Zeitraums, in dem die Zahlung von Erlösen aus Rücknahmen aufgrund ungünstiger Marktbedingungen nach Ansicht des Verwaltungsrats nachteilige Auswirkungen auf die Gesellschaft oder die verbleibenden Anteilinhaber der Gesellschaft haben kann; und
- f) während eines Zeitraums, in dem der Verwaltungsrat entscheidet, dass dies im besten Interesse der Anteilinhaber ist.

Eine solche Aussetzung ist streng auf den Zeitraum zu beschränken, der zur Bewältigung der sie rechtfertigenden außergewöhnlichen Umstände erforderlich ist, dies stets unter Berücksichtigung der besten Interessen der Anteilinhaber.

Eine Aussetzung muss von der Gesellschaft an ihrem eingetragenen Sitz und in den Tageszeitungen und über die weiteren Medien bekannt gegeben werden, die der Verwaltungsrat jeweils für diesen Zweck festlegt, und sie muss (unverzüglich) der Zentralbank sowie den Anteilinhabern mitgeteilt werden. Die Anträge von Anteilinhabern, die die Ausgabe oder Rücknahme von Anteilen einer Serie oder Klasse in beantragt haben, werden am ersten Handelstag nach Beendigung der Aussetzung bearbeitet, es sei denn, die Zeichnungs- bzw. Rücknahmeanträge wurden vor Beendigung der Aussetzung zurückgezogen. Soweit möglich werden alle angemessenen Maßnahmen ergriffen, um Aussetzungszeiträume schnellstmöglich zu beenden. Die Aufhebung einer Aussetzung ist der Zentralbank unverzüglich mitzuteilen.“

3. Der Unterabschnitt des Prospekts mit der Überschrift „*Rücknahme von Anteilen gegen Sachwerte*“ im Abschnitt „*Kauf- und Verkaufsinformationen*“ wird vollständig gestrichen und durch folgenden Wortlaut ersetzt:

„Rücknahme von Anteilen gegen Sachwerte. Jeder Fonds bietet Anlegern die Möglichkeit, an jedem Handelstag Anteile gegen Sachwerte zurückzugeben (sofern im entsprechenden Nachtrag nichts anderes festgelegt ist). „Gegen Sachwerte“ bedeutet in diesem Kontext, dass mit Zustimmung des Anteilinhabers statt der Lieferung des Barerlöses für eine Rückgabe die Gesellschaft Wertpapiere oder eine Kombination aus Zahlungsmitteln und Wertpapieren liefert, wobei die Zuteilung der Vermögenswerte der Genehmigung durch die Verwahrstelle bedarf. Rücknahmeanträge müssen vor dem im maßgeblichen Nachtrag festgelegten Orderannahmeschluss am betreffenden Handelstag beim Administrator eingehen. Die Zusammensetzung des von der Gesellschaft zu liefernden Wertpapierkorbes und eines geschätzten Barbetrages werden handelstäglich auf der Website veröffentlicht. Der genaue Wert der Barkomponente wird nach Berechnung des Nettoinventarwerts am jeweiligen Handelstag auf Basis der bei der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil verwendeten Preise ermittelt und entspricht der Differenz zwischen dem Wert der zurückzunehmenden Anteile und dem Wert des Wertpapierkorbes zu den bei der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil am selben Datum angewandten Preisen. Für sämtliche Rücknahmen gegen Sachwerte wird ein angemessener Betrag für Abgaben und Gebühren erhoben.

Wenn ein Anteilinhaber die Rücknahme einer Anzahl von Anteilen eines Fonds verlangt, die 5 % des Nettoinventarwerts oder mehr ausmachen, kann die Verwaltungsgesellschaft in ihrem alleinigen Ermessen beschließen, eine Rücknahme gegen Sachwerte anzubieten. Die zu übertragenden Vermögenswerte werden nach dem Ermessen der Verwaltungsgesellschaft, vorbehaltlich der Genehmigung der Verwahrstelle, ausgewählt und zu dem Wert angesetzt, der bei der Ermittlung des Rücknahmepreises der zurückzunehmenden Anteile angesetzt wurde. In diesem Fall verkauft die Verwaltungsgesellschaft, falls gewünscht, die Vermögenswerte im Auftrag und auf Kosten des Anteilinhabers und zahlt dem Anteilinhaber das Geld aus. Solche Ausschüttungen werden die Interessen der übrigen Anteilinhaber nicht wesentlich beeinträchtigen. Die Kosten einer solchen Veräußerung sind vom zurückgebenden Anteilinhaber zu tragen.

Werden Rücknahmen gegen Sachwerte zu Zwecken des Liquiditätsmanagements eingesetzt, dürfen diese nur zur Deckung von Rücknahmen aktiviert werden, die von professionellen Investoren beantragt wurden. Die unter solchen Umständen an den zurückgebenden Anleger übertragenen Wertpapiere entsprechen einem proportionalen Anteil am Fondsvermögen, es sei denn, es handelt sich um einen indexnachbildenden Fonds oder der Fonds wird ausschließlich an professionelle Investoren vertrieben.“

4. Die Definition des Begriffs „ESG-Filter“ in „*Anhang I – Definitionen*“ des Prospekts wird vollständig gestrichen und durch eine überarbeitete Definition ersetzt. Ferner werden neue Definitionen für die Begriffe „Verwässerungsabgabe“ und „Professioneller Investor“ mit folgenden Wortlaut hinzugefügt:

„Verwässerungsabgabe

eine Gebühr, die als Verwässerungsabgabe dient und alle expliziten sowie gegebenenfalls impliziten Transaktionskosten (geschätzt nach bestem Wissen und Gewissen) abdeckt, die für einen Fonds an jedem Handelstag anfallen, an dem Nettozeichnungen oder -rücknahmen stattfinden, um so die Handelskosten, die dem Fonds entstehen, zu decken;“

„ESG-Filter

ein von einem Indexanbieter und/oder dem Anlageverwalter und/oder dem betreffenden Unteranlageverwalter umgesetzter Filter (wie im maßgeblichen Fondsnachtrag erläutert), der die Ermittlung und den Ausschluss bestimmter potenzieller Komponenten in Bezug auf Verstöße gegen bestimmte ökologische, soziale oder die Unternehmensführung betreffende Kriterien zum Ziel hat;“

„Professioneller Investor

ein Anleger, der als professioneller Kunde gilt oder auf Antrag als professioneller Kunde im Sinne von Anhang II der Richtlinie 2014/65/EU behandelt werden kann;“

5. Der Unterabschnitt im Prospekt mit der Überschrift „*Stimmrechtsvertretung & Asset-Stewardship*“ im Abschnitt „*Allgemeine Informationen*“ wird vollständig gestrichen und durch folgenden Wortlaut ersetzt:

„Stimmrechtsvertretung & Asset-Stewardship

Die Stimmrechtsvertretung und Mitwirkung in Bezug auf Wertpapiere, die von einem oder mehreren Fonds gehalten werden, können gemäß den Bestimmungen der Richtlinie für eine nachhaltige Stimmrechtsvertretung und Mitwirkung erfolgen, die unter Sustainability Stewardship Service Proxy Voting and Engagement Policy („Richtlinie für eine nachhaltige Stewardship“) abrufbar ist, oder gemäß der/den einschlägigen Richtlinie(n) oder dem Ansatz, wie sie im maßgeblichen Fondsnachtrag dargelegt sind.

Die Richtlinie für eine nachhaltige Stewardship konzentriert sich auf die Risiken und Chancen, die sich auf die langfristige Wertschöpfung auswirken können. Dabei liegt der Schwerpunkt auf Nachhaltigkeitsprioritäten wie Klimawandel, Natur und Menschenrechte.

Für bestimmte Fonds hat die Gesellschaft, sofern im maßgeblichen Fondsnachtrag nichts anderes angegeben wird, die Zuständigkeit für die Ausübung von Stimmrechten und für Mitwirkungsaktivitäten gemäß der Richtlinie für eine nachhaltige Stewardship an den Anlageverwalter delegiert. Der Anlageverwalter kann nach seinem uneingeschränkten Ermessen jeweils eine unabhängige dritte Partei ernennen und ihr die mit bestimmten von den Fonds gehaltenen Wertpapieren verbundenen Stimmrechte übertragen, wenn dies aufgrund aufsichtsrechtlicher oder anderer Anforderungen erforderlich ist.

Für den/die betreffende(n) Fonds sind regelmäßige Berichte über die Stimmrechtsvertretung und Mitwirkungsaktivitäten im Rahmen der Richtlinie für eine nachhaltige Stewardship unter Sustainability Stewardship Service Proxy Voting and Engagement Policy verfügbar.“

6. Der Unterabschnitt im Prospekt mit der Überschrift „*ESG-Anlagen*“ im Abschnitt „*Allgemeine Informationen*“ wird vollständig gestrichen und durch folgenden Wortlaut ersetzt:

„ESG-Anlagen

Anlagen in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) bezeichnet die Beurteilung wesentlicher ESG-Themen während des Anlageprozesses. Sie ergänzt herkömmliches Research wie die Analyse von Abschlüssen, Branchentrends und Wachstumsstrategien von Unternehmen.

ESG-Anlagen können von Anlegern in vielerlei Weise zur Erzielung einer breiten Auswahl von Anlagezielen genutzt werden, u. a. Risikomanagement, Wertausrichtung und zur Steigerung einer nachhaltig langfristigen Wertentwicklung, und können in die Anlagepolitik eines Fonds gemäß Beschreibung im maßgeblichen Nachtrag auf einem oder mehreren, nachstehend näher beschriebenen Wegen einbezogen werden.

Um die verschiedenen Anlageziele dieser Anleger zu unterstützen, kann der Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter, wie im maßgeblichen Fondsnachtrag erläutert, ein ESG-Kriterium als Kernbereich oder zusätzlich zu der im maßgeblichen Nachtrag beschriebenen Anlagepolitik des Fonds anwenden. Das heißt, dass einige Fonds auf ESG-spezifische Ergebnisse abzielen, während andere Fonds, die nicht in erster Linie ESG-Ergebnisse zum Ziel haben, ESG-Tools zusätzlich zu ihrem Hauptziel zur Verbesserung des Risikomanagements und Ermöglichung verantwortlicher Anlagen einbeziehen. Jeder Fonds wurde gemäß SFDR klassifiziert, und dies wurde in den maßgeblichen Nachträgen angegeben.

Zusätzliche Informationen in Bezug den ESG-Anlageansatz von State Street Investment Management sind auf www.ssga.com/esg zu finden. Werden die ESG-Kriterien und/oder der Anlageansatz eines Unter-Anlageverwalters oder eines anderen Dritten angewendet, wird dies im maßgeblichen Fondsnachtrag dargelegt, zusammen mit einem Hinweis darauf, wo zusätzliche Informationen vorzufinden sind.

Die Fonds verfolgen keine Reduzierung negativer externer Effekte, die durch zugrunde liegende Anlagen verursacht werden, und berücksichtigen deshalb keine wesentlichen nachteiligen Auswirkungen ihrer Anlageentscheidungen, sofern nicht anderweitig im maßgeblichen Nachtrag angegeben.

Im Sinne von Artikel 4 der SFDR berücksichtigt die Verwaltungsgesellschaft nicht die nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren auf ihrer Unternehmensebene.“

7. Der Unterabschnitt im Prospekt mit der Überschrift „*Einbeziehung von ESG*“ im Abschnitt „*Allgemeine Informationen*“ wird vollständig gestrichen und durch folgenden Wortlaut ersetzt:

„Einbeziehung von ESG

Die Einbeziehung von ESG bezeichnet die Einbeziehung qualitativer und quantitativer ESG-Informationen in den Anlageprozess, einschließlich Nachhaltigkeitsrisiken, und soll Anlageentscheidungen optimieren. Die Einbeziehung von ESG zielt darauf ab, die finanzielle Performance zu verbessern und/oder die finanziellen Risiken zu mindern. Dabei werden ESG-Faktoren explizit und systematisch in Anlageanalyse und -entscheidungen einbezogen, um die Risiken zu senken und Erträge zu generieren. Die Einbeziehung von ESG ist ein breit angelegtes Instrument, bei dem wesentliche ESG-Komponenten als Risiko- und/oder Renditetreiber betrachtet werden und nicht als Mittel, um bestimmte ökologische, soziale und/oder die Unternehmensführung betreffende Ziele zu erreichen. Die Anwendung der Einbeziehung von ESG auf einen bestimmten Fonds sollte, in Übereinstimmung mit dem jeweiligen Fondsnachtrag passgenau auf die jeweilige Anlageklasse, Anlagestrategie und das angestrebte Ergebnis zugeschnitten werden. Bei der Erwägung der geeigneten Konzeption kann der Anlageverwalter oder der betreffende Unteranlageverwalter oder ein anderer Dritter beurteilen, ob und wie finanziell wesentliche ESG-Themen in seine Entscheidungsprozesse integriert werden, und dabei angemessene ESG-Signale und -Faktoren zur Risikominderung berücksichtigen sowie Chancen für die langfristige Performance ermitteln.“

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

GLOBALER NACHTRAG

19. Februar 2026

SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „**Gesellschaft**“) ist eine offene Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.

Dieser globale Nachtrag enthält eine Auflistung aller derzeit von der Zentralbank zugelassenen Fonds der Gesellschaft:

State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF
State Street SPDR MSCI All Country World Investable Market UCITS ETF
State Street SPDR MSCI All Country World UCITS ETF
State Street SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF
State Street SPDR MSCI Emerging Markets UCITS ETF
State Street SPDR MSCI Emerging Markets Small Cap UCITS ETF
State Street SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF
State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF
State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF
State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF
State Street SPDR S&P UK Dividend Aristocrats UCITS ETF
State Street SPDR FTSE UK All Share UCITS ETF
State Street SPDR S&P 500 UCITS ETF
State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF
State Street SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF
State Street SPDR MSCI EMU UCITS ETF
SPDR Bloomberg EM Inflation Linked Local Bond UCITS ETF
State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF
State Street SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF
State Street SPDR FTSE EPRA Europe ex UK Real Estate UCITS ETF
State Street SPDR MSCI Japan UCITS ETF
State Street SPDR MSCI World UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg 3-7 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF
State Street SPDR S&P 500 Leaders UCITS ETF
SPDR STOXX Global Low Volatility UCITS ETF
SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF
State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF

44851590.61

State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF
 State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF
 State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF
 SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF
 State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF
 State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond UCITS ETF
 State Street SPDR S&P 500 Quality Aristocrats UCITS ETF
 State Street SPDR S&P Developed Quality Aristocrats UCITS ETF
 State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF
 State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap Leaders UCITS ETF
 State Street SPDR S&P Europe Quality Aristocrats UCITS ETF
 State Street Saudi Arabia Enhanced Active Equity UCITS ETF
 State Street Global Dividend Spotlight Active Equity UCITS ETF
 State Street All World Enhanced Active Equity UCITS ETF
 State Street World Small Cap Enhanced Active Equity UCITS ETF

Dieser Nachtrag (der „**globale Nachtrag**“) ist Teil des Prospekts der Gesellschaft vom 19. Februar 2026 (der „**Prospekt**“) im Sinne der OGAW-Vorschriften. Dieser globale Nachtrag ist zusammen mit dem Prospekt und dem jeweiligen Fondsnachtrag des Fonds zu lesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem globalen Nachtrag verwendeten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten diesen globalen Nachtrag, die jeweiligen Fondsnachträge und den Prospekt sorgfältig und vollständig lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses globalen Nachtrags, des Prospekts oder eines Fondsnachtrags irgendwelche Zweifel haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler, Bankberater, Anwalt, Buchprüfer und/oder Finanzberater.

Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in einen Fonds die im Prospekt beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen.

Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „**Verwaltungsratsmitglieder**“), deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen. Nach bestem Wissen und Gewissen der Gesellschaft und der Verwaltungsratsmitglieder (die alle angemessene Sorgfalt darauf verwendet haben, dies sicherzustellen) stimmen die in diesem Nachtrag enthaltenen Angaben mit den Tatsachen überein und lassen nichts aus, was die Bedeutung der Angaben beeinträchtigen könnte. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder übernehmen dementsprechend die Verantwortung.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

29. April 2026

State Street SPDR MSCI All Country World UCITS ETF

Nachtrag Nr. 1

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR MSCI All Country World UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR MSCI All Country World UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Februar, Mai, August und Dezember jeden Jahres), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	Für Zeichnungen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag, für Rücknahmen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	MSCI ACWI (All Country World Index) Index (NDUEACWF).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.msci.com/constituents http://www.msci.com/resources/factsheets/index_fact_sheet/msci-acwi-net.pdf

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		USD abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		EUR abgesichert	
Name	State Street SPDR MSCI All Country World UCITS ETF		State Street SPDR MSCI All Country World USD Hdg UCITS ETF		State Street SPDR MSCI All Country World GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR MSCI All Country World CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR MSCI All Country World EUR Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		USD		GBP		CHF		EUR	
Währungsgesicherter Index	k. A.		MSCI ACWI with Developed Markets 100% hedged to USD Index		MSCI ACWI with Developed Markets 100% hedged to GBP Index		MSCI ACWI with Developed Markets 100% hedged to CHF Index		MSCI ACWI with Developed Markets 100% hedged to EUR Index	
Index Ticker	NDUEACWF		M4CXUBLR		M5CXUBL		MXCXUBL		M1CXUBLR	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,12 %		Bis zu 0,17 %							

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von Aktienmärkten aus Industrie- und Schwellenländern.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung der globalen Aktienmärkte und erfasst Aktien aus Industrie- und Schwellenländern. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („**währungsgesicherter Index**“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Optimierungsstrategie, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten

Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben. Der Fonds kann auch über Stock Connect oder unter Nutzung des QFI-Status des Anlageverwalters oder Unteranlageverwalters in chinesischen A-Aktien anlegen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI durch den Fonds beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte (einschließlich Non-Deliverable Forwards) sowie auf Optionsscheine. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking

Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company,

Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen.

Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Schwellenländerrisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und

Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe.

Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in der Volksrepublik China: Neben den Risiken von Anlagen in Schwellenländern zählen zu den Risiken von Anlagen in Märkten der VRC unter anderem Handelsaussetzungen, Beschränkungen von Währungstransfers/-engagements, Stornierungen oder Änderungen von Anweisungen, Grenzen für das Halten von Anlagen in der VRC und die Inanspruchnahme von Maklern, nicht erprobte Konzepte für die neue Handhabung des wirtschaftlichen Eigentums, die Abhängigkeit von einem/mehreren Zugangsprogramm(en), das/die eingestellt oder wesentlich verändert werden können, technologische System- und Kontrollrisiken im Zusammenhang mit solchen Zugangsprogrammen, Verwahrstellenrisiken, einschließlich einer mangelnden Trennung der Vermögenswerte von denen des QFI und anderer Intermediäre im Rahmen der betreffenden Zugangsprogramme und der betreffenden Unterdepotbanken, sowie steuerliche Unsicherheiten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend

negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt **„Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“** des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Aktienmärkte von Industrie- und Schwellenländern weltweit suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR MSCI All Country World UCITS ETF (Acc)
State Street SPDR MSCI All Country World EUR Hdg UCITS ETF (Acc)
State Street SPDR MSCI All Country World USD Hdg UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 30. April 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 29. Oktober 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 13 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und

Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR MSCI All Country World UCITS ETF

„MSCI ACWI (All Country World Index) Index“ ist eine Marke der MSCI und deren Konzerngesellschaften und wurde zur Verwendung durch die State Street Corporation für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR MSCI All Country World UCITS ETF, der auf dem MSCI ACWI (All Country World Index) Index basiert, wurde von der MSCI nicht im Hinblick auf seine Rechtmäßigkeit oder Eignung überprüft und wird nicht von der MSCI begeben, unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben.

DER STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF WIRD VON MSCI INC. NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER BEWORBEN. IHREN INFORMATIONSLIEFERANTEN ODER ANDEREN MIT DER ZUSAMMENSTELLUNG, BERECHNUNG ODER SCHAFFUNG EINES MSCI INDEX BEFASSTEN ODER VERBUNDENEN PARTEIEN (ZUSAMMEN DIE „MSCI-PARTEIEN“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. DIE MSCI-INDIZES STEHEN IM AUSSCHLIESSLICHEN EIGENTUM VON MSCI. MSCI UND DIE NAMEN DER MSCI-INDIZES SIND MARKEN VON MSCI ODER IHRER KONZERNGESELLSCHAFTEN UND WURDEN ZUR VERWENDUNG ZU BESTIMMTEN ZWECKEN DURCH STATE STREET CORPORATION LIZENZIERT. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN AB HINSICHTLICH DER RATSAMKEIT EINER ANLAGE IN FONDS IM ALLGEMEINEN ODER IN DEN STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF IM BESONDEREN ODER DER FÄHIGKEIT EINES MSCI-INDEX, DIE JEWEILIGE AKTIENMARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN. MSCI ODER IHRE KONZERNGESELLSCHAFTEN SIND DIE LIZENZGEBER BESTIMMTER MARKEN, DIENSTLEISTUNGSMARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DER MSCI-INDIZES, DIE VON MSCI OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF ODER DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WERDEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN UNTERLIEGT EINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DER MSCI-INDIZES DIE BELANGE DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN ZU BERÜCKSICHTIGEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN IST FÜR DIE FESTLEGUNG DES AUSGABEZITPUNKTS, DER AUSGABEPREISE ODER DES AUSGABEUMFANGS DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER, ODER DES BETRAGES, GEGEN DEN ANTEILE DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF ZURÜCKGEGEBEN WERDEN KÖNNEN, VERANTWORTLICH ODER IST DARAN BETEILIGT. WEITERHIN UNTERLIEGT KEINE DER MSCI-PARTEIEN EINER VERPFLICHTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM ANGEBOT DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF.

OBWOHL MSCI INFORMATIONEN ZUR AUFNAHME IN DIE MSCI-INDIZES ODER ZUR VERWENDUNG BEI DEREN BERECHNUNG VON QUELLEN ERHÄLT, DIE MSCI ALS VERLÄSSLICH BETRACHTET, GEWÄHRLEISTET KEINE DER MSCI-PARTEIEN DIE ECHTHEIT, RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG AB HINSICHTLICH DER VOM EMITTENTEN DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF, DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN DURCH DIE VERWENDUNG EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. KEINE DER MSCI-PARTEIEN HAFTET FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN IN VERBINDUNG MIT MSCI-INDIZES ODER DARIN ENTHALTENEN DATEN.

HINSICHTLICH DER MSCI-INDIZES UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT KEINE DER MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNGEN IRGEND EINER ART AB UND HIERMIT SCHLIESSEN DIE MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICH JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK AUS. UNBESCHADET DES VORSTEHENDEN HAFTEN DIE MSCI-PARTEIEN IN KEINEM FALL FÜR UNMITTELBARE, MITTELBARE ODER KONKRETE SCHÄDEN, STRAFSCHADENERSATZ, FOLGESCHÄDEN ODER ANDERE SCHÄDEN (EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), SELBST WENN SIE VON DER MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN UNTERRICHTET WURDEN.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von MSCI Limited:

MSCI ACWI (All Country World Index) Index.

Zum Datum des Nachtrags ist kein Unternehmen von MSCI Limited im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. MSCI Limited ist und bleibt von der britischen Finanzaufsicht (Financial Conduct Authority; „FCA“) als britischer Benchmark-Administrator zugelassen und reguliert (und ist im Finanzdienstleistungsregister der FCA (Financial Services Register) zu finden); MSCI Limited wird jedoch in Bezug auf die EU als in einem Drittstaat angesiedelter britischer Administrator betrachtet und wird gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung nicht im ESMA-Register eingetragen, sofern nicht und bis die EU eine Äquivalenzentscheidung bezogen auf das Vereinigte Königreich trifft oder bis MSCI der Status „Übernahme“ oder „Anerkennung“ gewährt wird.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 2

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Limited und State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für alle Zeichnungen und Rücknahmen: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) wenn für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg Global Aggregate Bond Index (LEGATRUU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussmittelkurse für Euro-, britische und japanische Staatsanleihen und Schlussgeldkurse für alle übrigen Wertpapiere.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilstklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		USD abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		EUR abgesichert		SGD abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond USD Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond SGD Hdg UCITS ETF	
Aus-schüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		USD		GBP		CHF		EUR		SGD	
Währungsgesi-cherter Index	k. A.		Bloomberg Global Aggregate Bond Index (USD Hedged)		Bloomberg Global Aggregate Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg Global Aggregate Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg Global Aggregate Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg Global Aggregate Bond Index (SGD Hedged)	
Index Ticker	LEGATRUU		LEGATRUH		LEGATRGH		LEGATRCH		LEGATREH		H00038SG	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,10 %											

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung der globalen Märkte für festverzinsliche Anleihen mit Investment Grade.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung der globalen Märkte für festverzinsliche Anleihen mit Investment Grade. Der Referenzindex erfasst Staatsanleihen, Anleihen staatlicher Stellen und Unternehmensanleihen, aber auch mit ABS-, MBS- und CMBS-Anleihen von Emittenten aus Industrie- und Schwellenländern. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („**währungsgesicherter Index**“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ im Prospekt näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des

Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen, Unternehmensanleihen, ABS-Anleihen, MBS-Anleihen, CMBS-Anleihen, Pfandbriefe und gesicherte Anleihen sein. Der Fonds kann außerdem in Anleihen investieren, die auf dem CIBM begeben werden. Der Fonds kann alle oder im Wesentlichen alle derartigen Anlagen über Zugangsprogramme/Bond Connect tätigen, wie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Anlageziel und Anlagepolitik eines Fonds“ des Prospekts beschrieben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate und TBA-Wertpapiere: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Der Fonds kann sich über Wertpapiere auf „To Be Announced“-Basis („TBA“) in MBS-Anleihen engagieren. TBA-Wertpapiere werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von TBAs**“ des Prospekts näher beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale

Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können versuchen, den Index

nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Risiken im Zusammenhang mit MBS- und sonstigen

ABS-Anleihen: Anlagen in MBS- und sonstigen ABS-Anleihen unterliegen in höherem Maße Risiken in Bezug auf erhebliche Bonitätsherabstufungen, Illiquidität und Ausfälle als viele andere festverzinsliche Anlagearten. Fallen die Zinsen, können MBS- und ABS-Anleihen gekündigt oder vorzeitig getilgt werden. Das kann dazu führen, dass der Fonds die Erlöse zu niedrigeren Zinsen in andere Anlagen investieren muss. Steigen die Zinsen, kann sich die durchschnittliche Laufzeit MBS- und ABS-Anleihen verlängern, sodass Zinsen unterhalb des Marktniveaus festgeschrieben werden. Das erhöht die Duration und die Zinssensibilität eines Wertpapiers und verringert seinen Wert. Es kann schwierig werden, Rechte auf die zugrunde liegenden Anlagen oder Sicherheiten durchzusetzen, und die zugrunde liegenden Anlagen oder Sicherheiten reichen unter Umständen nicht aus, wenn der Emittent ausfällt.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit

Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet

werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Schwellenländerrisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe.

Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in der Volksrepublik China: Neben den Risiken von Anlagen in Schwellenländern zählen zu den Risiken von Anlagen in Märkten der VRC unter anderem Handelsaussetzungen, Beschränkungen von Währungstransfers/-engagements, Stornierungen oder Änderungen von Anweisungen, Grenzen für das Halten von Anlagen in der VRC und die Inanspruchnahme von Maklern, nicht erprobte Konzepte für die neue Handhabung des wirtschaftlichen Eigentums, die Abhängigkeit von Zugangsprogrammen, die eingestellt oder wesentlich verändert werden können, technologische System- und Kontrollrisiken im Zusammenhang mit solchen Zugangsprogrammen, Verwahrstellenrisiken, einschließlich einer mangelnden Trennung der Vermögenswerte von denen des Antragstellers und anderer Intermediäre im Rahmen der betreffenden Zugangsprogramme und der betreffenden Unterdepotbanken, sowie steuerliche Unsicherheiten.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der

Wertentwicklung der globalen Märkte für festverzinsliche Schuldtitel mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF (Dist);
State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond USD HdG UCITS ETF (Acc);
State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond USD HdG UCITS ETF (Dist);
State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond GBP HdG UCITS ETF (Dist);
State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond CHF HdG UCITS ETF (Acc);
State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond EUR HdG UCITS ETF (Dist); und
State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond EUR HdG UCITS ETF (Acc).

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder von den Unteranlageverwaltern festgelegten und dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilten Beträgen entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg Global Aggregate Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Global Aggregate Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg Global Aggregate Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG GLOBAL AGGREGATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG GLOBAL AGGREGATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG GLOBAL AGGREGATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENE DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH

STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTE ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG GLOBAL AGGREGATE BOND UCITS ETF ODER BLOOMBERG GLOBAL AGGREGATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg Global Aggregate Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg Global Aggregate Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR MSCI All Country World Investable Market UCITS ETF

Nachtrag Nr. 3

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR MSCI All Country World Investable Market UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR MSCI All Country World Investable Market UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.

Informationsklassifizierung: Allgemeines

Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Februar, Mai, August und Dezember jeden Jahres), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	Für Zeichnungen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag, für Rücknahmen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	MSCI ACWI IMI (All Country World Investable Market Index) Index (MIMUAWON).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.msci.com/constituents http://www.msci.com/resources/factsheets/index_fact_sheet/msci-acwi-imi-net.pdf

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR MSCI All Country World Investable Market UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Acc	Dist
Währung der Anteilsklasse	USD	
Index Ticker	MIMUAWON	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,17 %	

*Ausschüttungspolitik: „Acc“ = Thesaurierende Anteile; „Dist“ = Ausschüttende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von Aktienmärkten aus Industrie- und Schwellenländern.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung der globalen Aktienmärkte insgesamt und erfasst Large-, Mid- und Small-Caps aus Industrie- und Schwellenländern. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Optimierungsstrategie, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben. Der Fonds kann auch über Stock Connect oder unter Nutzung des QFI-Status des Anlageverwalters oder Unteranlageverwalters in chinesischen A-Aktien anlegen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an

den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Untanlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Risiken im Zusammenhang mit kleineren Unternehmen: Die Wertpapiere von Unternehmen mit geringer, mittlerer und kleinster Kapitalisierung reagieren mitunter volatil und werden seltener und in kleineren Stückzahlen gehandelt als die Wertpapiere größerer Unternehmen. Solche Unternehmen verfügen unter Umständen über begrenzte Produktlinien, Märkte oder Finanzmittel, ihre Wettbewerbsstärke kann geringer sein als bei größeren Unternehmen und sie sind womöglich von

wenigen Schlüsselpersonen in ihrer Belegschaft abhängig. Hinzu kommt, dass diese Unternehmen möglicherweise nur eine kurze oder gar keine Erfolgshistorie aufweisen.

Schwellenländerisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe.

Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in der Volksrepublik China: Neben den Risiken von Anlagen in Schwellenländern zählen zu den Risiken von Anlagen in Märkten der VRC unter anderem Handelsaussetzungen, Beschränkungen von Währungstransfers/-engagements, Stornierungen oder Änderungen von Anweisungen, Grenzen für das Halten von Anlagen in der VRC und die Inanspruchnahme von Maklern, nicht erprobte Konzepte für die neue Handhabung des wirtschaftlichen Eigentums, die Abhängigkeit von Zugangsprogrammen, die eingestellt oder wesentlich verändert werden können, technologische System- und Kontrollrisiken im Zusammenhang mit solchen Zugangsprogrammen, Verwahrstellenrisiken, einschließlich einer mangelnden Trennung der Vermögenswerte von denen des QFI und anderer Intermediäre im Rahmen der betreffenden Zugangsprogramme und der betreffenden Unterdepotbanken, sowie steuerliche Unsicherheiten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „**Derivate**“ unter „**Zugelassene Anlagen**“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Aktienmärkte von Industrie- und Schwellenländern weltweit suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

„MSCI ACWI IMI (All Country World Investable Market Index) Index“ ist eine Marke der MSCI und deren Konzerngesellschaften und wurde zur Verwendung durch die State Street Corporation für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF, der auf dem MSCI ACWI IMI (All Country World Investable Market Index) Index basiert, wurde von der MSCI nicht im Hinblick auf seine Rechtmäßigkeit oder Eignung überprüft und wird nicht von der MSCI begeben, unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben.

DER STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF WIRD VON MSCI INC. („MSCI“), IHREN KONZERNGESELLSCHAFTEN, IHREN INFORMATIONSLIEFERANTEN ODER ANDEREN MIT DER ZUSAMMENSTELLUNG, BERECHNUNG ODER SCHAFFUNG EINES MSCI INDEX BEFASSTEN ODER VERBUNDENEN PARTEIEN (ZUSAMMEN DIE „MSCI-PARTEIEN“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER BEWORBEN. DIE MSCI-INDIZES STEHEN IM AUSSCHLIESSLICHEN EIGENTUM VON MSCI. MSCI UND DIE NAMEN DER MSCI-INDIZES SIND MARKEN VON MSCI ODER IHRER KONZERNGESELLSCHAFTEN UND WURDEN ZUR VERWENDUNG ZU BESTIMMTEN ZWECKEN DURCH STATE STREET CORPORATION LIZENZIERT. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN AB HINSICHTLICH DER RATSAMKEIT EINER ANLAGE IN FONDS IM ALLGEMEINEN ODER IN DEN STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF IM BESONDEREN ODER DER FÄHIGKEIT EINES MSCI-INDEX, DIE JEWEILIGE AKTIENMARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN. MSCI ODER IHRE KONZERNGESELLSCHAFTEN SIND DIE LIZENZGEBER BESTIMMTER MARKEN, DIENSTLEISTUNGSMARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DER MSCI-INDIZES, DIE VON MSCI OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF ODER DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WERDEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN UNTERLIEGT EINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DER MSCI-INDIZES DIE BELANGE DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN ZU BERÜCKSICHTIGEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN IST FÜR DIE FESTLEGUNG DES AUSGABEZITPUNKTS, DER AUSGABEPREISE ODER DES AUSGABEUMFANGS DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER, ODER DES BETRAGES, GEGEN DEN ANTEILE DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF ZURÜCKGEGEBEN WERDEN KÖNNEN, VERANTWORTLICH ODER IST DARAN BETEILIGT. WEITERHIN UNTERLIEGT KEINE DER MSCI-PARTEIEN EINER VERPFLICHTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM ANGEBOT DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF.

OBWOHL MSCI INFORMATIONEN ZUR AUFNAHME IN DIE MSCI-INDIZES ODER ZUR VERWENDUNG BEI DEREN BERECHNUNG VON QUELLEN ERHÄLT, DIE MSCI ALS VERLÄSSLICH BETRACHTET, GEWÄHRLEISTET KEINE DER MSCI-PARTEIEN DIE ECHTHEIT, RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG AB HINSICHTLICH DER VOM EMITTENTEN DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF, DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD INVESTABLE MARKET UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN DURCH DIE VERWENDUNG EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE.

KEINE DER MSCI-PARTEIEN HAFTET FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN IN VERBINDUNG MIT MSCI-INDIZES ODER DARIN ENTHALTENEN DATEN. HINSICHTLICH DER MSCI-INDIZES UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT KEINE DER MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNGEN IRGEND EINER ART AB UND HIEMIT SCHLIESSEN DIE MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICH JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK AUS. UNBESCHADET DES VORSTEHENDEN HAFTEN DIE MSCI-PARTEIEN IN KEINEM FALL FÜR UNMITTELBARE, MITTELBARE ODER KONKRETE SCHÄDEN, STRAFSCHADENERSATZ, FOLGESCHÄDEN ODER ANDERE SCHÄDEN (EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), SELBST WENN SIE VON DER MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN UNTERRICHTET WURDEN.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von MSCI Limited:

MSCI ACWI IMI (All Country World Investable Market Index) Index.

Zum Datum des Nachtrags ist kein Unternehmen von MSCI Limited im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. MSCI Limited ist und bleibt von der britischen Finanzaufsicht (Financial Conduct Authority, „FCA“) als britischer Benchmark-Administrator zugelassen und reguliert (und ist im Finanzdienstleistungsregister der FCA (Financial Services Register) zu finden); MSCI Limited wird jedoch in Bezug auf die EU als in einem Drittstaat angesiedelter britischer Administrator betrachtet und wird gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung nicht im ESMA-Register eingetragen, sofern nicht und bis die EU eine Äquivalenzentscheidung bezogen auf das Vereinigte Königreich trifft oder bis MSCI der Status „Übernahme“ oder „Anerkennung“ gewährt wird.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

State Street SPDR MSCI Emerging Markets UCITS ETF

Nachtrag Nr. 4

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR MSCI Emerging Markets UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR MSCI Emerging Markets UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
ISIN-Code	IE00B469F816.
Gesamtkostenquote (TER)	Bis zu 0,18 %. Weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „ Gebühren und Kosten “ im Prospekt zu entnehmen.
Ausschüttungspolitik	Alle Erträge und Gewinne werden im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am vierten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	MSCI Emerging Markets Index (NDUEEGF).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.msci.com/constituents https://www.msci.com/resources/factsheets/index_fact_sheet/msci-emerging-markets-index-usd-net.pdf

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Aktienmarkt-Wertentwicklung der Schwellenmärkte.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung von Aktien aus Schwellenländern in aller Welt. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Grenzen erlauben dem Fonds, Positionen bis maximal 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds in vom selben Emittenten ausgegebenen einzelnen Indexkomponenten zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben. Der Fonds kann auch über Stock Connect oder unter Nutzung des QFI-Status des Anlageverwalters oder Unteranlageverwalters in chinesischen A-Aktien anlegen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI durch den Fonds beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte (einschließlich Non-Deliverable Forwards) sowie auf Optionsscheine. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom

27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquiden Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken

ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Schwellenländerrisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe.

Da der Fonds wesentlich in Schwellenmärkten engagiert ist, sollte eine Anlage im Fonds keinen bedeutenden Anteil am Anlageportfolio darstellen und ist unter Umständen nicht für jeden Anleger geeignet.

Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in der Volksrepublik China: Neben den Risiken von Anlagen in Schwellenländern zählen zu den Risiken von Anlagen in Märkten der VRC unter anderem Handelsaussetzungen, Stornierungen oder Änderungen von Anweisungen, Beschränkungen von Währungstransfers/-engagements, Grenzen für das Halten von Anlagen in der VRC und die Inanspruchnahme von Maklern, nicht erprobte Konzepte für die neue Handhabung des wirtschaftlichen Eigentums, die Abhängigkeit von Zugangsprogrammen, die eingestellt oder wesentlich verändert werden können, technologische System- und Kontrollrisiken im Zusammenhang mit solchen Zugangsprogrammen, Verwahrstellenrisiken, einschließlich einer mangelnden Trennung der Vermögenswerte von denen des Antragstellers und anderer Intermediäre im Rahmen der betreffenden Zugangsprogramme und der betreffenden Unterdepotbanken, sowie steuerliche Unsicherheiten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung von Aktien aus Schwellenländern suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und

Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

„MSCI Emerging Markets Index“ ist eine Marke der MSCI und deren Konzerngesellschaften und wurde zur Verwendung durch die State Street Corporation für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR MSCI Emerging Markets UCITS ETF, der auf dem MSCI Emerging Markets Europe Index basiert, wurde von der MSCI nicht im Hinblick auf seine Rechtmäßigkeit oder Eignung überprüft und wird nicht von der MSCI begeben, unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben.

DER STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF WIRD VON MSCI INC. („MSCI“), IHREN KONZERNGESELLSCHAFTEN, IHREN INFORMATIONSLIEFERANTEN ODER ANDEREN MIT DER ZUSAMMENSTELLUNG, BERECHNUNG ODER SCHAFFUNG EINES MSCI INDEX BEFASSTEN ODER VERBUNDENEN PARTEIEN (ZUSAMMEN DIE „MSCI-PARTEIEN“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER BEWORBEN. DIE MSCI-INDIZES STEHEN IM AUSSCHLIESSLICHEN EIGENTUM VON MSCI. MSCI UND DIE NAMEN DER MSCI-INDIZES SIND MARKEN VON MSCI ODER IHRER KONZERNGESELLSCHAFTEN UND WURDEN ZUR VERWENDUNG ZU BESTIMMTEN ZWECKEN DURCH STATE STREET CORPORATION LIZENZIERT. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN AB HINSICHTLICH DER RATSAMKEIT EINER ANLAGE IN FONDS IM ALLGEMEINEN ODER IN DEN STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF IM BESONDEREN ODER DER FÄHIGKEIT EINES MSCI-INDEX, DIE JEWEILIGE AKTIENMARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN. MSCI ODER IHRE KONZERNGESELLSCHAFTEN SIND DIE LIZENZGEBER BESTIMMTER MARKEN, DIENSTLEISTUNGSMARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DER MSCI-INDIZES, DIE VON MSCI OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF ODER DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WERDEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN UNTERLIEGT EINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DER MSCI-INDIZES DIE BELANGE DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN ZU BERÜCKSICHTIGEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN IST FÜR DIE FESTLEGUNG DES AUSGABEZITPUNKTS, DER AUSGABEPREISE ODER DES AUSGABEUMFANGS DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER, ODER DES BETRAGES, GEGEN DEN ANTEILE DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF ZURÜCKGEGEBEN WERDEN KÖNNEN, VERANTWORTLICH ODER IST DARAN BETEILIGT. WEITERHIN UNTERLIEGT KEINE DER MSCI-PARTEIEN EINER VERPFLICHTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM ANGEBOT DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF.

OBWOHL MSCI INFORMATIONEN ZUR AUFNAHME IN DIE MSCI-INDIZES ODER ZUR VERWENDUNG BEI DEREN BERECHNUNG VON QUELLEN ERHÄLT, DIE MSCI ALS VERLÄSSLICH BETRACHTET, GEWÄHRLEISTET KEINE DER MSCI-PARTEIEN DIE ECHTHEIT, RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG AB HINSICHTLICH DER VOM EMITTENTEN DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF, DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN DURCH DIE VERWENDUNG EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. KEINE DER MSCI-PARTEIEN HAFTET FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN IN VERBINDUNG MIT MSCI-INDIZES ODER DARIN ENTHALTENEN DATEN. HINSICHTLICH DER MSCI-INDIZES UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT KEINE DER MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNGEN IRGEND EINER ART AB UND HIERMIT SCHLIESSEN DIE MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICH JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK AUS.

UNBESCHADET DES VORSTEHENDEN HAFTEN DIE MSCI-PARTEIEN IN KEINEM FALL FÜR UNMITTELBARE, MITTELBARE ODER KONKRETE SCHÄDEN, STRAFSCHADENERSATZ, FOLGESCHÄDEN ODER

ANDERE SCHÄDEN (EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), SELBST WENN SIE VON DER MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN UNTERRICHTET WURDEN.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von MSCI Limited:

MSCI Emerging Markets Index

Zum Datum des Nachtrags ist kein Unternehmen von MSCI Limited im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. MSCI Limited ist und bleibt von der britischen Finanzaufsicht (Financial Conduct Authority, „FCA“) als britischer Benchmark-Administrator zugelassen und reguliert (und ist im Finanzdienstleistungsregister der FCA (Financial Services Register) zu finden); MSCI Limited wird jedoch in Bezug auf die EU als in einem Drittstaat angesiedelter britischer Administrator betrachtet und wird gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung nicht im ESMA-Register eingetragen, sofern nicht und bis die EU eine Äquivalenzentscheidung bezogen auf das Vereinigte Königreich trifft oder bis MSCI der Status „Übernahme“ oder „Anerkennung“ gewährt wird.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR MSCI Emerging Markets Small Cap UCITS ETF

Nachtrag Nr. 5

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR MSCI Emerging Markets Small Cap UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR MSCI Emerging Markets Small Cap UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untereinlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
ISIN-Code	IE00B48X4842.
Gesamtkostenquote (TER)	Bis zu 0,55 %. Weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „ Gebühren und Kosten “ im Prospekt zu entnehmen.
Ausschüttungspolitik	Alle Erträge und Gewinne werden im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am vierten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	MSCI Emerging Markets Small Cap Index (MSLUERN).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.msci.com/constituents https://www.msci.com/resources/factsheets/index_fact_sheet/msci-emerging-markets-small-cap-index-net.pdf

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Aktienmarkt-Wertentwicklung des Small-Cap-Segments (Unternehmen mit geringer Marktkapitalisierung) in den Schwellenländern.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung von Small-Caps aus Schwellenländern in aller Welt. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Optimierungsstrategie, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI

beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen

direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquiden Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Schwellenländerrisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe. **Da der Fonds wesentlich in Schwellenmärkten engagiert ist, sollte eine**

Anlage im Fonds keinen bedeutenden Anteil am Anlageportfolio darstellen und ist unter Umständen nicht für jeden Anleger geeignet.

Risiken im Zusammenhang mit kleineren Unternehmen: Die Wertpapiere von Unternehmen mit geringer, mittlerer und kleinster Kapitalisierung reagieren mitunter volatil und werden seltener und in kleineren Stückzahlen gehandelt als die Wertpapiere größerer Unternehmen. Solche Unternehmen verfügen unter Umständen über begrenzte Produktlinien, Märkte oder Finanzmittel, ihre Wettbewerbsstärke kann geringer sein als bei größeren Unternehmen und sie sind womöglich von wenigen Schlüsselpersonen in ihrer Belegschaft abhängig. Hinzu kommt, dass diese Unternehmen möglicherweise nur eine kurze oder gar keine Erfolgshistorie aufweisen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „**Derivate**“ unter „**Zugelassene Anlagen**“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung von Small-Caps aus Schwellenländern suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

State Street SPDR MSCI Emerging Markets Small Cap UCITS ETF

„MSCI Emerging Markets Small Cap Index“ ist eine Marke der MSCI und deren Konzerngesellschaften und wurde zur Verwendung durch die State Street Corporation für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR MSCI Emerging Markets Small Cap UCITS ETF, der auf dem MSCI Emerging Markets Small Cap Index basiert, wurde von der MSCI nicht im Hinblick auf seine Rechtmäßigkeit oder Eignung überprüft und wird nicht von der MSCI begeben, unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben.

DER STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF WIRD VON MSCI INC. („MSCI“), IHREN KONZERNGESELLSCHAFTEN, IHREN INFORMATIONSLIEFERANTEN ODER ANDEREN MIT DER ZUSAMMENSTELLUNG, BERECHNUNG ODER SCHAFFUNG EINES MSCI INDEX BEFASSTEN ODER VERBUNDENEN PARTEIEN (ZUSAMMEN DIE „MSCI-PARTEIEN“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER BEWORBEN. DIE MSCI-INDIZES STEHEN IM AUSSCHLIESSLICHEN EIGENTUM VON MSCI. MSCI UND DIE NAMEN DER MSCI-INDIZES SIND MARKEN VON MSCI ODER IHRE KONZERNGESELLSCHAFTEN UND WURDEN ZUR VERWENDUNG ZU BESTIMMTEN ZWECKEN DURCH STATE STREET CORPORATION LIZENZIERT. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN AB HINSICHTLICH DER RATSAMKEIT EINER ANLAGE IN FONDS IM ALLGEMEINEN ODER IN DEN STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF IM BESONDEREN ODER DER FÄHIGKEIT EINES MSCI-INDEX, DIE JEWEILIGE AKTIENMARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN. MSCI ODER IHRE KONZERNGESELLSCHAFTEN SIND DIE LIZENZGEBER BESTIMMTER MARKEN, DIENSTLEISTUNGSMARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DER MSCI-INDIZES, DIE VON MSCI OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF ODER DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WERDEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN UNTERLIEGT EINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DER MSCI-INDIZES DIE BELÄNGE DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN ZU BERÜCKSICHTIGEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN IST FÜR DIE FESTLEGUNG DES AUSGABEZITPUNKTS, DER AUSGABEPREISE ODER DES AUSGABEUMFANGS DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER, ODER DES BETRAGES, GEGEN DEN ANTEILE DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF ZURÜCKGEGEBEN WERDEN KÖNNEN, VERANTWORTLICH ODER IST DARAN BETEILIGT. WEITERHIN UNTERLIEGT KEINE DER MSCI-PARTEIEN EINER VERPFLICHTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM ANGEBOT DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF.

OBWOHL MSCI INFORMATIONEN ZUR AUFNAHME IN DIE MSCI-INDIZES ODER ZUR VERWENDUNG BEI DEREN BERECHNUNG VON QUELLEN ERHÄLT, DIE MSCI ALS VERLÄSSLICH BETRACHTET, GEWÄHRLEISTET KEINE DER MSCI-PARTEIEN DIE ECHTHEIT, RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG AB HINSICHTLICH DER VOM EMITTENTEN DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF, DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI EMERGING MARKETS SMALL CAP UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN DURCH DIE VERWENDUNG EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. KEINE DER MSCI-PARTEIEN HAFTET FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN IN VERBINDUNG MIT MSCI-INDIZES ODER DARIN ENTHALTENEN DATEN. HINSICHTLICH DER MSCI-INDIZES UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT KEINE DER MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNGEN IRGENDWEINER ART AB UND HIERMIT SCHLIESSEN DIE MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICH JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK AUS. UNBESCHADET DES VORSTEHENDEN HAFTEN DIE MSCI-PARTEIEN IN KEINEM FALL FÜR UNMITTELBARE, MITTELBARE ODER KONKRETE SCHÄDEN, STRAFSCHADENERSATZ, FOLGESCHÄDEN ODER ANDERE SCHÄDEN (EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), SELBST WENN SIE VON DER MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN UNTERRICHTET WURDEN.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von MSCI Limited:

MSCI Emerging Markets Small Cap Index

Zum Datum des Nachtrags ist kein Unternehmen von MSCI Limited im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. MSCI Limited ist und bleibt von der britischen Finanzaufsicht (Financial Conduct Authority, „FCA“) als britischer Benchmark-Administrator zugelassen und reguliert (und ist im Finanzdienstleistungsregister der FCA (Financial Services Register) zu finden); MSCI Limited wird jedoch in Bezug auf die EU als in einem Drittstaat angesiedelter britischer Administrator betrachtet und wird gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung nicht im ESMA-Register eingetragen, sofern nicht und bis die EU eine Äquivalenzentscheidung bezogen auf das Vereinigte Königreich trifft oder bis MSCI der Status „Übernahme“ oder „Anerkennung“ gewährt wird.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

Nachtrag Nr. 6

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
ISIN-Code	IE00B466KX20.
Gesamtkostenquote (TER)	Bis zu 0,55 %. Weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „ Gebühren und Kosten “ im Prospekt zu entnehmen.
Ausschüttungspolitik	Alle Erträge und Gewinne werden im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Der Verwaltungsrat oder die Verwaltungsgesellschaft können nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	MSCI EM (Emerging Markets) Asia Index (NDUEEGFA).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.msci.com/constituents http://www.msci.com/resources/factsheets/index_fact_sheet/msci-emerging-markets-asia.pdf

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Aktienmarkt-Wertentwicklung von Schwellenmärkten in Asien.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung von Aktien aus asiatischen Schwellenländern. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Grenzen erlauben dem Fonds, Positionen bis maximal 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds in vom selben Emittenten ausgegebenen einzelnen Indexkomponenten zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben. Der Fonds kann auch über Stock Connect oder unter Nutzung des QFI-Status des Anlageverwalters oder Unteranlageverwalters in chinesischen A-Aktien anlegen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene

Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die

Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Schwellenländerrisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe. **Da der Fonds wesentlich in Schwellenmärkten engagiert ist, sollte eine Anlage im Fonds keinen bedeutenden Anteil am Anlageportfolio darstellen und ist unter Umständen nicht für jeden Anleger geeignet.**

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Region, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten aus dieser Region betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Region, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in der Volksrepublik China: Neben den Risiken von Anlagen in Schwellenländern zählen zu den Risiken von Anlagen in Märkten der VRC unter anderem Handelsaussetzungen, Stornierungen oder Änderungen von Anweisungen, Beschränkungen von Währungstransfers/-engagements, Grenzen für das Halten von Anlagen in der VRC und die Inanspruchnahme von Maklern, nicht erprobte Konzepte für die neue Handhabung des wirtschaftlichen Eigentums, die Abhängigkeit von Zugangsprogrammen, die eingestellt oder wesentlich verändert werden können, technologische System- und Kontrollrisiken im Zusammenhang mit solchen Zugangsprogrammen, Verwahrstellenrisiken, einschließlich einer mangelnden Trennung der Vermögenswerte von denen des Antragstellers und anderer Intermediäre im Rahmen der betreffenden Zugangsprogramme und der betreffenden Unterdepotbanken, sowie steuerliche Unsicherheiten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „**Derivate**“ unter „**Zugelassene Anlagen**“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt

„Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“
des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung von Aktien asiatischer Schwellenländer suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

State Street SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

„MSCI EM (Emerging Markets) Asia Index“ ist eine Marke von Morgan Stanley Capital International Inc. („MSCI“) und ihren Konzerngesellschaften und wurde für die Verwendungen durch die State Street Corporation für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF, der auf dem MSCI EM (Emerging Markets) Asia Index basiert, wurde von MSCI nicht im Hinblick auf seine Rechtmäßigkeit oder Eignung überprüft und wird nicht von MSCI begeben, unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben.

DER STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF WIRD VON MSCI INC. („MSCI“), IHREN KONZERNGESELLSCHAFTEN, IHREN INFORMATIONSLIEFERANTEN ODER ANDEREN MIT DER ZUSAMMENSTELLUNG, BERECHNUNG ODER SCHAFFUNG EINES MSCI INDEX BEFASSTEN ODER VERBUNDENEN PARTEIEN (ZUSAMMEN DIE „MSCI-PARTEIEN“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER BEWORBEN. DIE MSCI-INDIZES STEHEN IM AUSSCHLIESSLICHEN EIGENTUM VON MSCI. MSCI UND DIE NAMEN DER MSCI-INDIZES SIND MARKEN VON MSCI ODER IHRER KONZERNGESELLSCHAFTEN UND WURDEN ZUR VERWENDUNG ZU BESTIMMTEN ZWECKEN DURCH STATE STREET CORPORATION LIZENZIERT. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN AB HINSICHTLICH DER RATSAMKEIT EINER ANLAGE IN FONDS IM ALLGEMEINEN ODER IN DEN STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF IM BESONDEREN ODER DER FÄHIGKEIT EINES MSCI-INDEX, DIE JEWEILIGE AKTIENMARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN. MSCI ODER IHRE KONZERNGESELLSCHAFTEN SIND DIE LIZENZGEBER BESTIMMTER MARKEN, DIENSTLEISTUNGSMARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DER MSCI-INDIZES, DIE VON MSCI OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DES STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF ODER DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WERDEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN UNTERLIEGT EINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DER MSCI-INDIZES DIE BELANGE DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN ZU BERÜCKSICHTIGEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN IST FÜR DIE FESTLEGUNG DES AUSGABEZEITPUNKTS, DER AUSGABEPREISE ODER DES AUSGABEUMFANGS DES STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER, ODER DES BETRAGES, GEGEN DEN ANTEILE DES STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF ZURÜCKGEGEBEN WERDEN KÖNNEN, VERANTWORTLICH ODER IST DARAN BETEILIGT. WEITERHIN UNTERLIEGT KEINE DER MSCI-PARTEIEN EINER VERPFLICHTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM ANGEBOT DES STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF.

OBWOHL MSCI INFORMATIONEN ZUR AUFNAHME IN DIE MSCI-INDIZES ODER ZUR VERWENDUNG BEI DEREN BERECHNUNG VON QUELLEN ERHÄLT, DIE MSCI ALS VERLÄSSLICH BETRACHTET, GEWÄHRLEISTET KEINE DER MSCI-PARTEIEN DIE ECHTHEIT, RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG AB HINSICHTLICH DER VOM EMITTENTEN DES STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF, DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI EM ASIA UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN DURCH DIE VERWENDUNG EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. KEINE DER MSCI-PARTEIEN HAFTET FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN IN VERBINDUNG MIT MSCI-INDIZES ODER DARIN ENTHALTENEN DATEN. HINSICHTLICH DER MSCI-INDIZES UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT KEINE DER MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNGEN IRGEND EINER ART AB UND HIERMIT SCHLIESSEN DIE MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICH JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK AUS. UNBESCHADET DES VORSTEHENDEN HAFTEN DIE MSCI-PARTEIEN IN KEINEM FALL FÜR UNMITTELBARE, MITTELBARE ODER KONKRETE SCHÄDEN, STRAFSCHADENERSATZ, FOLGESCHÄDEN ODER ANDERE SCHÄDEN (EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), SELBST WENN SIE VON DER MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN UNTERRICHTET WURDEN.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von MSCI Limited:

MSCI EM (Emerging Markets) Asia Index

Zum Datum des Nachtrags ist kein Unternehmen von MSCI Limited im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. MSCI Limited ist und bleibt von der britischen Finanzaufsicht (Financial Conduct Authority, „FCA“) als britischer Benchmark-Administrator zugelassen und reguliert (und ist im Finanzdienstleistungsregister der FCA (Financial Services Register) zu finden); MSCI Limited wird jedoch in Bezug auf die EU als in einem Drittstaat angesiedelter britischer Administrator betrachtet und wird gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung nicht im ESMA-Register eingetragen, sofern nicht und bis die EU eine Äquivalenzentscheidung bezogen auf das Vereinigte Königreich trifft oder bis MSCI der Status „Übernahme“ oder „Anerkennung“ gewährt wird.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 9

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	EUR
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg Euro Aggregate Bond Index (LBEATREU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussmittelkurse für Euro-Staatsanleihen und Schlussgeldkurse für alle übrigen Wertpapiere.
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	EUR nicht abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		USD abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond USD Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	EUR		GBP		CHF		USD	
Währungsgesich-erter Index	k. A.		Bloomberg Euro Aggregate Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg Euro Aggregate Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg Euro Aggregate Bond Index (USD Hedged)	
Index Ticker	LBEATREU		H02000GB		H02000CH		H02000US	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,17 %		Bis zu 0,22 %		Bis zu 0,22 %		Bis zu 0,22 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für festverzinsliche, auf Euro lautende Anleihen mit Investment Grade.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des gesamten Marktes für auf Euro lautende Anleihen. Die Wertpapiere müssen festverzinslich sein, auf Euro lauten, steuerpflichtig und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Der Referenzindex erfasst Staatsanleihen, Anleihen staatlicher Stellen und Unternehmensanleihen, aber auch mit Forderungen, Hypotheken und kommerziellen Hypotheken unterlegte Wertpapiere. Die Aufnahme in den Index erfolgt auf Basis der Emissionswährung, nicht auf Basis des Sitzes des Emittenten. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“** näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen

ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen, Unternehmensanleihen, ABS-Anleihen, MBS-Anleihen, CMBS-Anleihen, Pfandbriefe und gesicherte Anleihen sein.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“** des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“** im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift **„Risiko der Wertpapierleihe“** im Abschnitt **„Risikoinformationen“** des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von

Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die

Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditschwierigkeiten unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters bzw. des Unteranlageverwalters dennoch weiter halten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den

Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Märkte für festverzinsliche, auf Euro lautende Anleihen mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg Euro Aggregate Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF wird von Bloomberg oder Barclays nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Euro Aggregate Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg Euro Aggregate Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG EURO AGGREGATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG EURO AGGREGATE BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG EURO AGGREGATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG EURO AGGREGATE BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN

DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG EURO AGGREGATE BOND UCITS ETF ODER BLOOMBERG EURO AGGREGATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg Euro Aggregate Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg Euro Aggregate Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 10

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	EUR
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg Euro Treasury Bond Index (LEATTREU)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussmittelkurse.
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	EUR nicht abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		USD abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond USD Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	EUR		GBP		CHF		USD	
Währungsgesicherte r Index	k. A.		Bloomberg Euro Treasury Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg Euro Treasury Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg Euro Treasury Bond Index (USD Hedged)	
Index Ticker	LEATTREU		H02004GB		H02004CH		H02004US	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,07 %	Bis zu 0,07 %	Bis zu 0,12 %		Bis zu 0,12 %		Bis zu 0,12 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Staatsanleihenmarktes der Eurozone.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für Staatsanleihen der Eurozone. Nur auf Euro oder eine Altwährung der Eurozone lautende Anleihen sind im Index enthalten. Die Wertpapiere müssen festverzinslich und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“** näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse

wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, kann es sich unter anderem um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen handeln.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“** des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können

gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder Region, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung oder aus dieser Region betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung oder Region, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Märkte für Staatsanleihen der Eurozone suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter

Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF (Dist)

State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg Euro Treasury Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Euro Treasury Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg Euro Treasury Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG EURO TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG EURO GOVERNMENT BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG EURO TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN/DIE NAME(N) DES/DER BLOOMBERG EURO TREASURY BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG EURO GOVERNMENT BOND UCITS ETF ODER BLOOMBERG EURO TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL: Bloomberg Euro Treasury Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg Euro Treasury Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 11

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	EUR
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg Euro Corporate Bond Index (LECP TREU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	EUR nicht abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		USD abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond USD Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	EUR		GBP		CHF		USD	
Währungsgesicherter Index	k. A.		Bloomberg Euro Corporate Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg Euro Corporate Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg Euro Corporate Bond Index (USD Hedged)	
Index Ticker	LECP TREU		H02002GB		H02002CH		H02002US	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,12 %		Bis zu 0,17 %		Bis zu 0,17 %		Bis zu 0,17 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für festverzinsliche, auf Euro lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für Euro-Unternehmensanleihen. Die Wertpapiere müssen festverzinslich sein, auf Euro lauten und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Die Aufnahme in den Index erfolgt auf Basis der Emissionswährung, nicht auf Basis des Sitzes des Emittenten. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des

Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen, Unternehmensanleihen, ABS-Anleihen, MBS-Anleihen, CMBS-Anleihen, Pfandbriefe und gesicherte Anleihen sein.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem

Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditschwierigkeiten unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters bzw. des Unteranlageverwalters dennoch weiter halten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch

nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für auf Euro lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten, dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilten Beträgen entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF

BLOOMBERG® und Bloomberg Euro Corporate Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Euro Corporate Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg Euro Corporate Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg Euro Corporate Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG EURO CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG EURO CORPORATE BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG EURO CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG EURO CORPORATE BOND INDEX ODER DIE DAMIT

VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEDLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG EURO CORPORATE BOND UCITS ETF ODER BLOOMBERG EURO CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg Euro Corporate Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg Euro Corporate Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR® und S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF

Nachtrag Nr. 12

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	GBP
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg UK Gilt Bond Index (LSG1TRGU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussmittelkurse.
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	GBP nicht abgesichert		EUR abgesichert		CHF abgesichert		USD abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg UK Gilt EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg UK Gilt CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg UK Gilt USD Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	GBP		EUR		CHF		USD	
Währungsgesich- erter Index	k. A.		Bloomberg UK Gilt Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg UK Gilt Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg UK Gilt Bond Index (USD Hedged)	
Index Ticker	LSG1TRGU		H06245EU		H06245CH		H06245US	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,15 %		Bis zu 0,20 %		Bis zu 0,20 %		Bis zu 0,20 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Performance des Marktes für britische Staatsanleihen (Gilts).

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für britische Staatsanleihen (Gilts) und beinhaltet öffentliche Schuldtitel des Vereinigten Königreichs. Die Wertpapiere müssen festverzinslich und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds anhand einer Nachbildungsstrategie, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ im Prospekt näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters

entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, kann es sich unter anderem um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen handeln.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Untereinlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher

könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf einen bestimmten Markt, eine bestimmte Währung oder eine geringe Zahl von Anleihen, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten dieses Marktes, dieser Währung oder dieser geringen Zahl von Anleihen betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Markt, eine Währung oder eine geringe Zahl von Anleihen, auf den/die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „**Derivate**“ unter „**Zugelassene Anlagen**“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Untereinlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der

Wertentwicklung des Marktes für britische Staatsanleihen (Gilt) suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF

BLOOMBERG® und Bloomberg UK Gilt Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg UK Gilt Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg UK Gilt Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg UK Gilt UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG UK GILT INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG UK GILT UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG UK GILT INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG UK GILT INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND

IRGENDEINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG UK GILT UCITS ETF ODER BLOOMBERG UK GILT INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg UK Gilt Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg UK Gilt Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 13

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	GBP
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg Sterling Corporate Bond Index (LC61TRGU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	GBP nicht abgesichert		EUR abgesichert		CHF abgesichert		USD abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond USD Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	GBP		EUR		CHF		USD	
Währungsgesich- erter Index	k. A.		Bloomberg Sterling Corporate Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg Sterling Corporate Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg Sterling Corporate Bond Index (USD Hedged)	
Index Ticker	LC61TRGU		H02571EU		H02571CH		H02571US	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,20 %		Bis zu 0,25 %		Bis zu 0,25 %		Bis zu 0,25 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für festverzinsliche, auf Pfund Sterling lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für auf Pfund Sterling lautende Unternehmensanleihen. Die Wertpapiere müssen festverzinslich sein, auf Pfund Sterling lauten und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Die Aufnahme in den Index erfolgt auf Basis der Emissionswährung, nicht auf Basis des Sitzes des Emittenten. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters

entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen, Unternehmensanleihen, ABS-Anleihen, MBS-Anleihen, CMBS-Anleihen, Pfandbriefe und gesicherte Anleihen sein.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016,

USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um

Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditschwierigkeiten unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters bzw. des Unteranlageverwalters dennoch weiter halten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Märkte für auf Pfund Sterling lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um

9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilkasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg Sterling Corporate Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF wird von Bloomberg oder Barclays nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Sterling Corporate Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg Sterling Corporate Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg Sterling Corporate Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG STERLING CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG STERLING CORPORATE BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG STERLING CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG STERLING CORPORATE BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEDLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG STERLING CORPORATE BOND UCITS ETF ODER BLOOMBERG STERLING CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg Sterling Corporate Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg Sterling Corporate Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 14

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteraanlageverwalter	State Street Global Advisors Limited und State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 15:00 Uhr. (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (LBUSTRUU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilstklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond CHF Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs- politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF	
Währungsgesich erter Index	k. A.		Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (CHF Hedged)	
Index Ticker	LBSTRUU		H00001EU		H00001GB		H00001CH	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,17 %		Bis zu 0,22 %		Bis zu 0,22 %		Bis zu 0,22 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für festverzinsliche, auf US-Dollar lautende, steuerpflichtige Anleihen mit Investment Grade.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des gesamten Marktes für auf US-Dollar lautende Anleihen. Die Wertpapiere müssen festverzinslich sein, auf US-Dollar lauten, steuerpflichtig und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Der Referenzindex erfasst Staatsanleihen, Anleihen staatlicher Stellen und Unternehmensanleihen, aber auch mit Forderungen, Hypotheken und kommerziellen Hypotheken unterlegte Wertpapiere. Die Aufnahme in den Index erfolgt auf Basis der Emissionswährung, nicht auf Basis des Sitzes des Emittenten. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“** im Prospekt näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte

für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen, Unternehmensanleihen, ABS-Anleihen, MBS-Anleihen, CMBS-Anleihen, Pfandbriefe und gesicherte Anleihen sein.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate und TBA-Wertpapiere: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“** des Prospekts beschrieben.

Der Fonds kann sich über Wertpapiere auf „To Be Announced“-Basis („TBA“) in MBS-Anleihen engagieren. TBA-Wertpapiere werden im Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von TBAs“** des Prospekts näher beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“** im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift **„Risiko der Wertpapierleihe“** im Abschnitt **„Risikoinformationen“** des Prospekts lesen. Das maximale

Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können versuchen, den Index

nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Risiken im Zusammenhang mit MBS- und sonstigen

ABS-Anleihen: Anlagen in MBS- und sonstigen ABS-Anleihen unterliegen in höherem Maße Risiken in Bezug auf erhebliche Bonitätsherabstufungen, Illiquidität und Ausfälle als viele andere festverzinsliche Anlagearten. Fallen die Zinsen, können MBS- und ABS-Anleihen gekündigt oder vorzeitig getilgt werden. Das kann dazu führen, dass der Fonds die Erlöse zu niedrigeren Zinsen in andere Anlagen investieren muss. Steigen die Zinsen, kann sich die durchschnittliche Laufzeit MBS- und ABS-Anleihen verlängern, sodass Zinsen unterhalb des Marktniveaus festgeschrieben werden. Das erhöht die Duration und die Zinssensibilität eines Wertpapiers und verringert seinen Wert. Es kann schwierig werden, Rechte auf die zugrunde liegenden Anlagen oder Sicherheiten durchzusetzen, und die zugrunde liegenden Anlagen oder Sicherheiten reichen unter Umständen nicht aus, wenn der Emittent ausfällt.

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder

vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditschwierigkeiten unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter dennoch weiter halten.

Derivaterisiko:

Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der

Wertentwicklung des Marktes für auf US-Dollar lautende Anleihen mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF (Dist); und
State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder von den Unteranlageverwaltern festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF

BLOOMBERG® und Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg U.S. Aggregate Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG U.S. AGGREGATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. AGGREGATE BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES SPDR BLOOMBERG U.S. AGGREGATE BOND UCITS ETF ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG U.S. AGGREGATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENE

DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM SPDR BLOOMBERG U.S. AGGREGATE BOND UCITS ETF ODER DEM STATE STREET BLOOMBERG U.S. AGGREGATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 15

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteraanlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg U.S. Treasury Bond Index (I00054US).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		MXN abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond MXN Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF		MXN	
Währungsgesich-erter Index	k. A.		Bloomberg U.S. Treasury Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg U.S. Treasury Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg U.S. Treasury Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg U.S. Treasury Bond Index (MXN Hedged)	
Index Ticker	I00054US		H00054EU		H00054GB		H00054CH		H00054MX	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,05 %		Bis zu 0,07 %							

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für US-Staatsanleihen.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für US-Staatsanleihen und beinhaltet öffentliche Schuldtitel des US-Schatzamts. Bestimmte Sonderemissionen, wie z. B. Serienanleihen einzelstaatlicher und lokaler Emittenten (State and Local Government Series Bonds – SLGs), TIPS und STRIPS, sind ausgeschlossen. Die Wertpapiere müssen festverzinslich und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter können unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des

Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, kann es sich unter anderem um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen handeln.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts

gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Untanlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder einen Markt, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung oder auf diesem Markt betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung oder einen Markt, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Untanlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für US-Schatzanleihen suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilkasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

BLOOMBERG® und Bloomberg U.S. Treasury Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF wird von Bloomberg Barclays nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg U.S. Treasury Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg U.S. Treasury Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG U.S. TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. TREASURY BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES SPDR BLOOMBERG U.S. TREASURY BOND UCITS ETF ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG U.S. TREASURY BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT

JEDLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM SPDR BLOOMBERG U.S. TREASURY BOND UCITS ETF ODER DEM STATE STREET BLOOMBERG U.S. TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg U.S. Treasury Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg U.S. Treasury Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 17

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untieranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited und State Street Global Advisors Singapore Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für alle Zeichnungen und Rücknahmen: 16:45 (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am vierten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg Emerging Markets Local Currency Liquid Government Bond Index (BECLTRUU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond USD Base CCY Hdg to EUR UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond USD Base CCY Hdg to GBP UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond USD Base CCY Hdg to CHF UCITS ETF	
Ausschüttungs- politik*	Dist	Acc	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF	
Währungsgesicherter Index	k. A.		Bloomberg Emerging Markets Local Currency Liquid Government Bond Index unhedged USD base hedged into EUR		Bloomberg Emerging Markets Local Currency Liquid Government Bond Index unhedged USD base hedged into GBP		Bloomberg Emerging Markets Local Currency Liquid Government Bond Index unhedged USD base hedged into CHF	
Index Ticker	BECLTRUU		I34429EU		I35154GB		I35155CH	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,55 %		Bis zu 0,60 %		Bis zu 0,60 %		Bis zu 0,60 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung investierbarer, auf Lokalwährungen lautender Anleihen von Schwellenländern (Emerging Markets).

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung investierbarer, auf Lokalwährungen lautender Anleihen von Schwellenländern. Der Index begrenzt das Länderengagement auf maximal 10 % und verteilt den überschüssigen Marktwert anteilig auf den gesamten Index. Für die Aufnahme in den Index müssen Wertpapiere festverzinslich sein, einen ausstehenden Betrag, der in Lokalwährung mindestens 1 Mrd. USD entspricht, sowie eine Restlaufzeit von über einem Jahr aufweisen und mit CCC oder besser bewertet sein, wie von der Indexmethodik festgelegt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Klassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Währung, auf die die jeweilige abgesicherte Klasse lautet, und der Basiswährung des Fonds zu mindern. Dies beinhaltet die Absicherung der Basiswährung des Fonds in der Währung der jeweiligen Klasse ohne Bezugnahme auf die im zugrunde liegenden Anlageportfolio des Fonds repräsentierten Währungen. Abgesicherte Klassen bilden in der Regel den entsprechenden währungsgesicherten Index genauer nach als der Index.

Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ im Prospekt näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, um in den abgesicherten Klassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Klasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser abgesicherten Klasse. Alle

diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der abgesicherten Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen, ABS-Anleihen, MBS-Anleihen, CMBS-Anleihen, Pfandbriefe und gesicherte Anleihen sein. Der Fonds kann außerdem in Anleihen investieren, die auf dem CIBM begeben werden. Der Fonds kann alle oder im Wesentlichen alle derartigen Anlagen über Zugangsprogramme/Bond Connect tätigen, wie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Anlageziel und Anlagepolitik eines Fonds“ des Prospekts beschrieben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren

beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder die Untermanager können versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Klassenrisiko: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder die Untermanager bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Region, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten aus dieser Region betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Region, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Schwellenländerisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder

Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe. **Da der Fonds wesentlich in Schwellenmärkten engagiert ist, sollte eine Anlage im Fonds keinen bedeutenden Anteil am Anlageportfolio darstellen und ist unter Umständen nicht für jeden Anleger geeignet.**

Risiken im Zusammenhang mit Wertpapieren mit niedrigerem Rating: Schuldtitel von minderer Qualität („High-Yield“- oder „Ramsch“-Anleihen) können mit erheblich höheren Ausfallrisiken verbunden sein als Schuldtitel von höherer Qualität. Sie können illiquide sein, ihr Wert kann heftig schwanken und kurzfristig stark fallen. Schuldtitel von minderer Qualität reagieren tendenziell stärker auf schlechte Nachrichten über den Emittenten, den Markt oder die Wirtschaft im Allgemeinen.

Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in der Volksrepublik China: Neben den Risiken von Anlagen in Schwellenländern zählen zu den Risiken von Anlagen in Märkten der VRC unter anderem Handelsaussetzungen, Beschränkungen von Währungstransfers/-engagements, Stornierungen oder Änderungen von Anweisungen, Grenzen für das Halten von Anlagen in der VRC und die Inanspruchnahme von Maklern, nicht erprobte Konzepte für die neue Handhabung des wirtschaftlichen Eigentums, die Abhängigkeit von Zugangsprogrammen, die eingestellt oder wesentlich verändert werden können, technologische System- und Kontrollrisiken im Zusammenhang mit solchen Zugangsprogrammen, Verwahrstellenrisiken, einschließlich einer mangelnden Trennung der Vermögenswerte von denen des Antragstellers und anderer Intermediäre im Rahmen der betreffenden Zugangsprogramme und der betreffenden Unterdepotbanken, sowie steuerliche Unsicherheiten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im Abschnitt „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Märkte für liquide auf Lokalwährungen

lautende Anleihen aus Schwellenländern suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete mittlere bis hohe Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Klassen werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF USD (Dist)

State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF USD (Acc)

State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond USD Base CCY Hdg to EUR UCITS ETF (Acc)

Alle anderen Klassen werden vom 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „**Erstausgabezeitraum**“) verfügbar sein. Der Erstausgabepreis wird ca. 30 in der Währung der jeweiligen Klasse betragen, zuzüglich eines angemessenen Aufschlags für Abgaben und Gebühren. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren Nettoinventarwert ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg Emerging Markets Local Currency Liquid Government Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Emerging Markets Local Currency Liquid Government Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg Emerging Markets Local Currency Liquid Government Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG EMERGING MARKETS LOCAL CURRENCY LIQUID GOVERNMENT BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG EMERGING MARKETS LOCAL BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG EMERGING MARKETS LOCAL CURRENCY LIQUID GOVERNMENT BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. WEDER BLOOMBERG NOCH BARCLAYS ÜBERNEHMEN BEZÜGLICH DES BLOOMBERG EMERGING MARKETS LOCAL CURRENCY LIQUID GOVERNMENT BOND INDEX ODER DER DARIN ENTHALTENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH

STILLSCHWEIGEND IRGENDWELCHE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE ALLGEMEINE MARKTGÄNGIGKEIT ODER DIE EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AUSDRÜCKLICH AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTE ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG EMERGING MARKETS LOCAL BOND UCITS ETF ODER BLOOMBERG EMERGING MARKETS LOCAL CURRENCY LIQUID GOVERNMENT BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg Emerging Markets Local Currency Liquid Government Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg Emerging Markets Local Currency Liquid Government Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt UCITS ETF

Nachtrag Nr. 18

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	GBP
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen: 14:00 (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg Sterling 1-5 Year Aggregate Gilts Bond Index (LF56TRGU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/ .

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussmittelkurse.
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilstklassen

Art der Anteilsklasse	GBP nicht abgesichert		EUR abgesichert		CHF abgesichert		USD abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt USD Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	GBP		EUR		CHF		USD	
Währungsgesich- erter Index	k. A.		Bloomberg Sterling 1-5 Year Aggregate Gilts Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg Sterling 1-5 Year Aggregate Gilts Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg Sterling 1-5 Year Aggregate Gilts Bond Index (USD Hedged)	
Index Ticker	LF56TRGU		H08049EU		H08049CH		H08049US	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,15 %		Bis zu 0,20 %		Bis zu 0,20 %		Bis zu 0,20 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für kurz laufende britische Staatsanleihen (Gilt).

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für britische Staatsanleihen (Gilt) und beinhaltet öffentliche Schuldtitel des Vereinigten Königreichs mit Laufzeiten zwischen 1 Jahr und bis zu (aber nicht einschließlich) 5 Jahren. Die Wertpapiere müssen festverzinslich und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds anhand einer Nachbildungsstrategie, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ im Prospekt näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge

spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, kann es sich unter anderem um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen handeln.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind

kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf einen bestimmten Markt, eine bestimmte Währung und/oder eine geringe Zahl von Anleihen, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten dieses Marktes, dieser Währung oder dieser geringen Zahl von Anleihen betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Markt, eine Währung oder eine geringe Zahl von Anleihen, auf den/die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „**Derivate**“ unter „**Zugelassene Anlagen**“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Märkte für kurz laufende britische Staatsanleihen suchen und bereit sind, die mit einer Anlage

dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg Sterling 1-5 Year Aggregate Gilts Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt Bond UCITS ETF wird von Bloomberg Barclays nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street Bloomberg 1-5 Year Gilt Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg Sterling 1-5 Year Aggregate Gilts Bond Index zu berücksichtigen. Barclays ist weder verantwortlich für noch beteiligt an der Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt Bond UCITS ETF. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year Gilt Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG STERLING 1-5 YEAR AGGREGATE GILTS BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-5 YEAR GILT BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG STERLING 1-5 YEAR AGGREGATE GILTS BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG STERLING 1-5 YEAR AGGREGATE GILTS BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEDGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT

ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-5 YEAR GILT BOND UCITS ETF ODER BLOOMBERG STERLING 1-5 YEAR AGGREGATE GILTS BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg Sterling 1-5 Year Aggregate Gilts Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg Sterling 1-5 Year Aggregate Gilts Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt UCITS ETF

Nachtrag Nr. 19

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	GBP
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

	Für Zeichnungen und Rücknahmen einer nicht abgesicherten Anteilsklasse gegen Barzahlung: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag.
	Für Zeichnungen und Rücknahmen einer abgesicherten Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag.
Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen der abgesicherten Anteilsklasse (gegen Barzahlung und Sachwerte): 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag.
	Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg Sterling 15+ Year Aggregate Gilts Bond Index (LF55TRGU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussmittelkurse.
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilstklassen

Art der Anteilsklasse	GBP nicht abgesichert		USD abgesichert		EUR abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt USD Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt EUR Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs- politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	GBP		USD		EUR	
Index Ticker	LF55TRGU		H08048US		H08048EU	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,15 %		Bis zu 0,20 %		Bis zu 0,20 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für lang laufende britische Staatsanleihen (Gilts).

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für britische Staatsanleihen (Gilts) und beinhaltet öffentliche Schuldtitel des Vereinigten Königreichs mit Laufzeiten von mehr als 15 Jahren. Die Wertpapiere müssen festverzinslich und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds anhand einer Nachbildungsstrategie, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ im Prospekt näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters

entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, kann es sich unter anderem um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen handeln.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One

Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um

Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf einen bestimmten Markt, eine bestimmte Währung oder eine geringe Zahl von Anleihen, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten dieses Marktes, dieser Währung oder dieser geringen Zahl von Anleihen betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Markt, eine Währung oder eine geringe Zahl von Anleihen, auf den/die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend

negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt **„Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“** des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Märkte für lang laufende britische Staatsanleihen suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete mittlere bis hohe Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilkasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt UCITS ETF

BLOOMBERG® und Bloomberg Sterling 15+ Year Aggregate GiltsBond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt Bond UCITS ETF wird von Bloomberg Barclays nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street Bloomberg 15+ Year Gilt Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg Sterling 15+ Year Aggregate Gilts Bond Index zu berücksichtigen. Barclays ist weder verantwortlich für noch beteiligt an der Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt Bond UCITS ETF. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 15+ Year Gilt Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG STERLING 15+ YEAR AGGREGATE GILTSBOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 15+ YEAR GILT BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG STERLING 15+ YEAR AGGREGATE GILTS BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG STERLING 15+ YEAR AGGREGATE GILTSBOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER

EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 15+ Year Gilt BOND UCITS ETF ODER BLOOMBERG STERLING 15+ YEAR AGGREGATE GILTSBOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg Sterling 15+ Year Aggregate GiltsBond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg Sterling 15+ Year Aggregate GiltsBond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 20

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	EUR
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteraanlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg Euro 1-3 Year Treasury Bond Index (LET1TREU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussmittelkurse für alle Wertpapiere
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	EUR nicht abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		USD abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond USD Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	EUR		GBP		CHF		USD	
Währungsgesich- erter Index	k. A.		Bloomberg Euro 1-3 Year Treasury Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg Euro 1-3 Year Treasury Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg Euro 1-3 Year Treasury Bond Index (USD Hedged)	
Index Ticker	LET1TREU		H02119GB		H02119CH		H02119US	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,15 %		Bis zu 0,20 %		Bis zu 0,20 %		Bis zu 0,20 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für kurzfristige Staatsanleihen der Eurozone.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für Staatsanleihen der Eurozone. Nur auf Euro oder eine Altwährung der Eurozone lautende Anleihen mit einer Laufzeit von 1 bis (aber nicht einschließlich) 3 Jahren sind im Index enthalten. Die Wertpapiere müssen festverzinslich und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“** im Prospekt beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des

Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, kann es sich unter anderem um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen handeln.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“** des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One

Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese

Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Märkte für kurz laufende Staatsanleihen der Eurozone suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

BLOOMBERG® und Bloomberg Euro 1-3 Year Treasury Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Euro 1-3 Year Treasury Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg Euro 1-3 Year Treasury Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG STERLING 1-3 YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-3 YEAR EURO GOVERNMENT BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG EURO 1-3 YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG STERLING 1-3 YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE

BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-3 YEAR EURO GOVERNMENT BOND UCITS ETF ODER BLOOMBERG EURO 1-3 YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg Euro 1-3 Year Treasury Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg Euro 1-3 Year Treasury Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc 19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 21

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	EUR
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index (BEHLTREU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	EUR nicht abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		USD abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond USD Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	EUR		GBP		CHF		USD	
Währungsgesich-erter Index	k. A.		Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index (USD Hedged)	
Index Ticker	BEHLTREU		H26990GB		H26990CH		H26990US	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,40 %		Bis zu 0,45 %		Bis zu 0,45 %		Bis zu 0,45 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für festverzinsliche, auf Euro lautende Hochzins-Unternehmensanleihen.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für hochverzinsliche Euro-Anleihen. Die Wertpapiere müssen festverzinsliche, auf Euro lautende erstrangige Unternehmensanleihen mit einer Laufzeit zwischen einem Jahr und bis zu (aber nicht einschließlich) 15 Jahren sein. Die Wertpapiere müssen einen ausstehenden Betrag von mindestens 250 Mio. EUR aufweisen und als High Yield eingestuft sein. Unter CCC- bewertete Wertpapiere sind wie von der Indexmethodik festgelegt ausgeschlossen. Emittenten haben eine Gewichtungsobergrenze von 5 % im Index. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen

Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die der Anlageverwalter nicht beeinflussen kann, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen, Unternehmensanleihen, ABS-Anleihen, MBS-Anleihen, CMBS-Anleihen, Pfandbriefe und gesicherte Anleihen sein.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von

Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen

Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Risiken im Zusammenhang mit Wertpapieren mit niedrigerem Rating: Schuldtitel von minderer Qualität („High-Yield“- oder „Ramsch“-Anleihen) können mit erheblich höheren Ausfallrisiken verbunden sein als Schuldtitel von höherer Qualität. Sie können illiquide sein, ihr Wert kann heftig schwanken und kurzfristig stark fallen. Schuldtitel von minderer Qualität reagieren tendenziell stärker auf schlechte Nachrichten über den Emittenten, den Markt oder die Wirtschaft im Allgemeinen. **Da der Fonds wesentlich in Anleihen ohne Investment Grade engagiert ist, sollte eine Anlage im Fonds keinen bedeutenden Anteil am Anlageportfolio darstellen und ist unter Umständen nicht für jeden Anleger geeignet.**

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditschwierigkeiten unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten

wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters dennoch weiter halten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter bestrebt sein wird sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Märkte für festverzinsliche, auf Euro lautende Hochzins-Unternehmensanleihen suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete mittlere bis hohe Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF (Dist); und
State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF (Acc).

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „**Erstausgabezeitraum**“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilklass, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

BLOOMBERG® and Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg Euro High Yield Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG LIQUIDITY SCREENED EURO HIGH YIELD BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG EURO HIGH YIELD BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG LIQUIDITY SCREENED EURO HIGH YIELD BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG LIQUIDITY SCREENED EURO HIGH YIELD BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG EURO HIGH YIELD BOND UCITS ETF ODER BLOOMBERG LIQUIDITY SCREENED EURO HIGH YIELD BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:
Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF

Nachtrag Nr. 22

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am vierten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P Emerging Markets High Yield Dividend Aristocrats Index (SPEMDANR).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Halbjährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/dividends-factors/sp-emerging-markets-high-yield-dividend-aristocrats-index/#overview https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD	
Index Ticker	SPEMDANR	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „ Gebühren und Kosten “ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,55 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von dividendenstarken Aktien in den Aktienmärkten von Schwellenländern.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus Schwellenländern. Die Wertpapiere müssen bestimmten Anforderungen an Streuung, Stabilität und Handel genügen und werden anschließend nach der Höhe ihrer Dividenden gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Limits erlauben es dem Fonds, Positionen in einzelnen Komponenten des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein

„Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquiden Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen

gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Schwellenländerisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe. **Da der Fonds wesentlich in Schwellenmärkten engagiert ist, sollte eine Anlage im Fonds keinen bedeutenden Anteil am Anlageportfolio darstellen und ist unter Umständen nicht für jeden Anleger geeignet.**

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine geringe Zahl von Aktien, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die diese geringe Zahl von Aktien betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine geringe Zahl von Aktien, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Risiken im Zusammenhang mit Russland: Dieser Fonds investiert in russische Wertpapiere. Solche Anlagen bergen erhebliche Risiken, wie sie im Prospekt genauer erläutert sind.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechende negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus Schwellenländern suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilkasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF

DER STATE STREET SPDR S&P EMERGING MARKETS DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P EMERGING MARKETS DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P EMERGING MARKETS DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P EMERGING MARKETS HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P EMERGING MARKETS HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET ODER DES STATE STREET SPDR S&P EMERGING MARKETS DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P EMERGING MARKETS HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P EMERGING MARKETS HIGHYIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DER GESELLSCHAFTER BZW. ANLEGER DES STATE STREET SPDR S&P EMERGING MARKETS DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P EMERGING MARKETS DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P EMERGING MARKETS DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P EMERGING MARKETS DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P EMERGING MARKETS DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P EMERGING MARKETS DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P EMERGING MARKETS HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P EMERGING MARKETS HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN GESELLSCHAFTERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P EMERGING MARKETS DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P EMERGING MARKETS HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P EMERGING MARKETS HIGHYIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P EMERGING MARKETS HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (U. A. EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P EMERGING MARKETS HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P Emerging Markets High Yield Dividend Aristocrats Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist SPDJI Limited im ESMA-Register (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als Administrator gemäß Artikel 33 der Benchmark-Verordnung eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

Nachtrag Nr. 23

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler, Bankberater oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März, Juni, September und Dezember), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem alleinigen Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen: 14:30 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am ersten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P High Yield Dividend Aristocrats Index (SPHYDAN).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/dividends-factors/sp-high-yield-dividend-aristocrats-index/%23overview https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF		State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats CHF Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF	
Währungsgesichert er Index	k. A.		S&P High Yield Dividend Aristocrats EUR Dynamic Hedged Index		S&P High Yield Dividend Aristocrats GBP Dynamic Hedged Index		S&P High Yield Dividend Aristocrats CHF Dynamic Hedged Index	
Index Ticker	SPHYDAN		SPHYDEDN		SPHYDGDN		SPHYSDN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,35 %		Bis zu 0,40 %					

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Teilfonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von bestimmten hohe Dividenden ausschüttenden Aktienwerten im US-Aktienmarkt.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus den USA. Die Wertpapiere müssen bestimmten Anforderungen an Streuung, Stabilität und Handel genügen und werden anschließend nach der Höhe ihrer Dividenden gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Limits erlauben es dem Fonds, Positionen in einzelnen Komponenten des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % zu halten.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert,

werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt

„Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf einen bestimmten Markt oder eine geringe Zahl von Aktien, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten dieses Marktes oder dieser Aktien betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Markt oder eine geringe Zahl von Aktien, auf den/die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer

Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus den USA suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF (Dist)

State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats EUR Hdg UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

DER STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET CORPORATION ODER DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (U. A. EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P High Yield Dividend Aristocrats Index

Zum Datum des Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register der Referenzwerte aus Drittstaaten (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als in Einklang mit Artikel 33 der Benchmark-Verordnung anerkannter Administrator eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

Nachtrag Nr. 24

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P 400 US Mid Cap UCITS ETF ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P 400 US Mid Cap UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März, Juni, September und Dezember), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem alleinigen Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen: 14:30 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am ersten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P MidCap 400 Index (SP400NTR).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/equity/sp-400/#overview https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P 400 US Mid Cap UCITS ETF		State Street SPDR S&P 400 US Mid Cap EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR S&P 400 US Mid Cap GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR S&P 400 US Mid Cap CHF Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF	
Währungsgesichert er Index	k. A.		S&P 400 EUR Dynamic Hedged Index		S&P 400 GBP Dynamic Hedged Index		S&P 400 CHF Dynamic Hedged Index	
Index Ticker	SP400NTR		SPMEUDHN		SPMGBDHN		SPMCHDHN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,30 %		Bis zu 0,35 %					

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung mittelständischer Unternehmen in den USA.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Aktien-Performance von 400 Unternehmen aus der mittleren Marktkapitalisierungskategorie der USA. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Limits erlauben es dem Fonds, Positionen in einzelnen Komponenten des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % zu halten.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder

vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren

beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich

potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf einen bestimmten Markt, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten dieses Marktes betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Markt, auf den der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des

Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt **„Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“** des Prospekts lesen.

Beträgen entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren Nettoinventarwert ausgegeben.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung US-amerikanischer Aktienmärkte suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P 400 US Mid Cap UCITS ETF (Acc); und

State Street SPDR S&P 400 US Mid Cap UCITS ETF (Dist); und

State Street SPDR S&P 400 US Mid Cap EUR Hdg UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der **„Erstausgabezeitraum“**). Der Erstausgabepreis für jede Anteilsklasse wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten und dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilten

State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

DER STATE STREET SPDR S&P 400 US MID CAP UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P 400 US MID CAP UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P 400 US MID CAP UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P MIDCAP 400 INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P MIDCAP 400 INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET CORPORATION ODER DES STATE STREET SPDR S&P 400 US MID CAP UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P MIDCAP 400 INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P MIDCAP 400 INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P 400 US MID CAP UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P 400 US MID CAP UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P 400 US MID CAP UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P 400 US MID CAP UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P 400 US MID CAP UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P 400 US MID CAP UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P MIDCAP 400 INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P MIDCAP 400 INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P 400 US MID CAP UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P MIDCAP 400 INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P MIDCAP 400 INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P MIDCAP 400 INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNNTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (UND INSBESONDERE FÜR ENTGANGENE GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P MIDCAP 400 INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P MidCap 400 Index.

Zum Datum dieses Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als Administrator gemäß Artikel 33 der Benchmark-Verordnung eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR S&P UK Dividend Aristocrats UCITS ETF

Nachtrag Nr. 25

((Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P UK Dividend Aristocrats UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P UK Dividend Aristocrats UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	GBP
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März und September), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 15:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Zeichnungen und Rücknahmen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P UK High Yield Dividend Aristocrats Index (SPUKHDAN).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/dividends-factors/sp-uk-high-yield-dividend-aristocrats-index/%23overview https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	GBP nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P UK Dividend Aristocrats UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	GBP	
Index Ticker	SPUKHDAN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,30 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von bestimmten hohe Dividenden ausschüttenden Aktienwerten, die von Unternehmen im Vereinigten Königreich emittiert werden.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus dem Vereinigten Königreich. Die Wertpapiere müssen bestimmten Anforderungen an Streuung, Stabilität und Handel genügen und werden anschließend nach der Höhe ihrer Dividenden gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Limits erlauben es dem Fonds, Positionen in einzelnen Komponenten des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein

„Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquiden Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen

gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf einen bestimmten Markt oder eine geringe Zahl von Aktien, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten dieses Marktes oder dieser Aktien betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Markt oder eine geringe Zahl von Aktien, auf den/die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein kurz-, mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung von dividendenstarken Aktien aus dem Vereinigten Königreich suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P UK Dividend Aristocrats UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

DER STATE STREET SPDR S&P UK DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P UK DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P UK DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P UK HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P UK HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET ODER DES STATE STREET SPDR S&P UK DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P UK HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P UK HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P UK DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P UK DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P UK DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P UK DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P UK DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P UK DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P UK HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P UK HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILINHABERN DES SPDR S&P UK DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P UK HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P UK HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P UK HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER

STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNNTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (U. A. EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P UK HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P UK High Yield Dividend Aristocrats Index

Zum Datum des Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als Administrator gemäß Artikel 33 der Benchmark-Verordnung eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF

Nachtrag Nr. 26

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	Euro
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Für französische Aktienpläne (PEA) geeignet	Ja
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März und September), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 14.30 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Zeichnungen und Rücknahmen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P Euro High Yield Dividend Aristocrats Index (SPEUHDAN).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/dividends-factors/sp-euro-high-yield-dividend-aristocrats/%23overview https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	18:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	EUR nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	EUR	
Index Ticker	SPEUHDAN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „ Gebühren und Kosten “ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,30 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Teilfonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von bestimmten dividendenstarken Aktienwerten, die von Unternehmen in der Eurozone emittiert werden.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus der Eurozone. Die Wertpapiere müssen bestimmten Anforderungen an Streuung, Stabilität und Handel genügen und werden anschließend nach der Höhe ihrer Dividenden gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Limits erlauben es dem Fonds, Positionen in einzelnen Komponenten des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State

Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Untanlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken

ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder eine geringe Zahl von Aktien oder eine Region, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung oder dieser Aktien oder aus dieser Region betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung oder eine geringe Zahl von Aktien oder eine Region, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung von dividendenstarken Aktien aus der Eurozone suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

DER STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET ODER DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (U. A. EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER DARIN

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNENTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P Euro High Yield Dividend Aristocrats Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als Administrator gemäß Artikel 33 der Benchmark-Verordnung eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR FTSE UK All Share UCITS ETF

Nachtrag Nr. 27

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR FTSE UK All Share UCITS ETF ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR FTSE UK All Share UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	GBP
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März und September), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei den thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen bar: 15:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	FTSE All-Share Index (FTPTTALL).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter http://www.ftse.com/Analytics/factsheets/Home/Search http://www.ftse.com/products/indices/uk

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	GBP nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR FTSE UK All Share UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	GBP	
Index Ticker	FTPTTALL	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,20 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des breiten britischen Aktienmarktes.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung der britischen Aktienmärkte insgesamt und erfasst Large-, Mid- und Small-Caps, die am Hauptmarkt der London Stock Exchange notieren. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Limits erlauben es dem Fonds, Positionen in einzelnen Komponenten des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Aktien investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn

die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen**“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „**Risiko der Wertpapierleihe**“ im Abschnitt „**Risikoinformationen**“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die

Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf einen bestimmten Markt, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten dieses Marktes betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Markt, auf den der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „**Derivate**“ unter „**Zugelassene Anlagen**“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung britischen Aktienmärkte suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Der State Street SPDR FTSE UK All Share ETF wird in keinerlei Weise durch die FTSE International Limited („FTSE“) oder durch Gesellschaften der London Stock Exchange Group („LSEG“) (zusammen die „lizenzgebenden Parteien“) gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben, und keine der lizenzgebenden Parteien macht Behauptungen oder Prognosen oder gibt ausdrückliche oder stillschweigende Erklärungen oder Zusicherungen ab hinsichtlich (i) der durch die Verwendung des FTSE All Share Index (der „Index“) (auf den der State Street SPDR FTSE UK All Share ETF basiert) zu erzielenden Ergebnisse, (ii) des Stands des Index zu einem bestimmten Zeitpunkt an einem bestimmten Tag oder in anderweitiger Hinsicht, oder (iii) der Eignung des Index für den Zweck, für den er in Zusammenhang mit dem State Street SPDR FTSE UK All Share ETF gebracht wird.

Keine der lizenzgebenden Parteien hat gegenüber der State Street Corporation oder deren Kunden eine Finanz- oder Anlageberatung erbracht oder eine Empfehlung im Zusammenhang mit dem Index ausgesprochen oder wird dies tun. Der Index wird von FTSE oder dessen Vertreter berechnet. Keine der lizenzgebenden Parteien (a) haftet (ob aus Fahrlässigkeit oder anderweitig) anderen Personen gegenüber für Fehler im Index oder (b) ist verpflichtet, andere Personen über Fehler darin zu informieren.

Sämtliche Rechte am Index liegen bei FTSE. „FTSE®“ ist eine Marke der LSEG und wird von der FTSE unter Lizenz benutzt.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von FTSE International Limited:

FTSE All-Share Index

Zum Datum des Nachtrags ist weder FTSE International Limited noch ein anderes Unternehmen von FTSE Russell im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR S&P 500 UCITS ETF

Nachtrag Nr. 28

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P 500 UCITS ETF ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P 500 UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März, Juni, September und Dezember jedes Jahr), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem alleinigen Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen: 14:30 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am ersten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P 500 Index (SPTR500N).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/equity/sp-500/#overview https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		MXN abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P 500 UCITS ETF		State Street SPDR S&P 500 EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR S&P 500 GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR S&P 500 CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR S&P 500 MXN Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF		MXN	
Währungsgesicherter Index	k. A.		S&P 500 EUR Dynamic Hedged Index		S&P 500 GBP Dynamic Hedged Index		S&P 500 CHF Dynamic Hedged Index		S&P 500 MXN Dynamic Hedged Index	
Index Ticker	SPTR500N		SPXEUDHN		SPXGBDHN		SPXCHDHN		SPXMXDHN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,03 %		Bis zu 0,05 %							

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von Large-Cap-Werten am US-amerikanischen Aktienmarkt.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung der Aktien der führenden 500 Unternehmen der USA. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Limits erlauben es dem Fonds, Positionen in einzelnen Komponenten des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % zu halten.

Es werden abgesicherte Anteilklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („**währungsgesicherter Index**“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert,

werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von**

derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf einen bestimmten Markt, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten dieses Marktes betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Markt, auf den der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung US-amerikanischer Aktienmärkte suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P 500 UCITS ETF (Dist)
State Street SPDR S&P 500 EUR Hdg UCITS ETF (Acc)
State Street SPDR S&P 500 UCITS ETF (Acc)
State Street SPDR S&P 500 GBP Hdg UCITS ETF (Dist)
State Street SPDR S&P 500 MXN Hdg UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „**Erstausgabezeitraum**“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilkasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR S&P 500 UCITS ETF

DER STATE STREET SPDR S&P 500 US MID CAP UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILHABERN DES STATE STREET SPDR S&P 500 UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET STATE STREET SPDR S&P 500 UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P 500 INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P 500 INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET CORPORATION ODER DES STATE STREET SPDR S&P 500 UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P 500 INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P 500 INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P 500 UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P 500 UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P 500 UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P 500 UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRÉCHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P 500 UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P 500 UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P 500 INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P 500 INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILHABERN DES STATE STREET SPDR S&P 500 UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P 500 INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P 500 INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P 500 INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (UND INSBESONDERE FÜR ENTGANGENE GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P 500 INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P 500 Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register der Referenzwerte aus Drittstaaten (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als in Einklang mit Artikel 33 der Benchmark-Verordnung anerkannter Administrator eingetragen.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

Nachtrag Nr. 31

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler, Bankberater oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März, Juni, September und Dezember), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem alleinigen Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR- Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	Für Zeichnungen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag, für Rücknahmen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Dow Jones Global Select Real Estate Securities Index (DWGRSN).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/equity/dow-jones-global-select-real-estate-securities-index/#overview https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD	
Index Ticker	DWGRSN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „ Gebühren und Kosten “ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,40 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des globalen Marktes für börsennotierte Immobilienwertpapiere.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der Index-Wertentwicklung zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung börsennotierter Immobiliengesellschaften, Equity-Real-Estate-Investment-Trusts („REITS“) und Immobilienbetreiber („REOCs“) aus Schwellen- und Industrieländern in aller Welt. Die Wertpapiere werden nach Liquidität, Größe und Umsatz gefiltert und anschließend marktkapitalisierungsgewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Limits erlauben es dem Fonds, Positionen in einzelnen Komponenten des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es

nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

REITS und REOCs: Der Fonds kann auch in Equity-Real-Estate-Investment-Trusts (Immobilien-Aktiengesellschaften mit börsennotierten Anteilen, „REITS“) und Real-Estate-Operating-Companies (Immobilienbetreiber, „REOCs“) investieren, die weltweit gehandelt werden.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Untanlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die

Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf einen bestimmten Sektor, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten aus diesem Sektor betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Sektor, auf den der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Risiken im Zusammenhang mit Real-Estate-Investment-Trusts („REITs“): REITs sind von ganz speziellen Managementkompetenzen abhängig, und ihre Anlagen können stark konzentriert sein. Bei Ausfall kann der REIT seine Rechte als Vermieter unter Umständen nur mit Verzögerung und zu erheblichen Kosten durchsetzen. REITs sind stark auf Cashflows angewiesen. Infolgedessen sind sie besonders kapitalmarktabhängig. Anlagen in REITs unterliegen ferner den Risiken, denen die Aktienmärkte im Allgemeinen ausgesetzt sind.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für börsennotierte Immobilienpapiere aus Industrie- und Schwellenländern suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete hohe Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

Standard & Poor's® und S&P® sind eingetragene Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“), und Dow Jones® ist eine eingetragene Marke der Dow Jones Trademark Holdings LLC („Dow Jones“). Die Marken wurden an die S&P Dow Jones Indices LLC und ihre Gruppenunternehmen lizenziert und wurden zur Verwendung für bestimmte Zwecke an State Street Global Advisors unterlizenziiert. Der „Dow Jones Global Select Real Estate Index“ ist ein Produkt der S&P Dow Jones Indices LLC und ihren Gruppenunternehmen und wurde zur Verwendung durch State Street Global Advisors lizenziert. Der State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate ETF wird von S&P Dow Jones Indices LLC, Dow Jones, S&P und ihren jeweiligen Gruppenunternehmen (zusammen „S&P Dow Jones Indices“) nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. S&P Dow Jones Indices gibt gegenüber den Anteilhabern des State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate ETF oder anderen Personen keinerlei ausdrückliche oder stillschweigende Erklärungen oder Zusicherungen in Bezug auf die Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder im State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate ETF im Besonderen oder der Fähigkeit des Dow Jones Global Select Real Estate Index ab, die allgemeine Marktentwicklung nachzubilden. Die Beziehung von S&P Dow Jones Indices zu State Street Global Advisors in Bezug auf den Dow Jones Global Select Real Estate Index beschränkt sich auf die Erteilung von Lizenzen für den Index und bestimmte Marken, Dienstleistungsmarken und/oder Handelsnamen von S&P Dow Jones Indices. Der Dow Jones Global Select Real Estate Index wird ohne Berücksichtigung von State Street Global Advisors oder des State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate ETF von S&P Dow Jones Indices festgelegt, zusammengestellt und berechnet. S&P Dow Jones Indices ist nicht verpflichtet, bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Dow Jones Global Select Real Estate Index die Belange von State Street Global Advisors oder der Anteilhaber des State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF zu berücksichtigen. S&P Dow Jones Indices ist nicht für die Festlegung der Preise und des Volumens des State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate ETF oder des Zeitpunkts der Ausgabe oder des Verkaufs des State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate ETF oder die Festlegung oder Berechnung der Gleichung, anhand derer der Rücknahmeanspruch der vom Fonds auszugebenden Anteile berechnet wird, zuständig noch daran beteiligt gewesen. S&P Dow Jones Indices hat keinerlei Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, dem Vertrieb oder dem Handel des State Street SPDR Dow Jones Global Real Estate ETF. Es kann nicht zugesichert werden, dass auf dem Dow Jones Global Select Real Estate Index basierende Anlageprodukte die Indexwertentwicklung exakt nachbilden oder positive Anlagerenditen liefern. S&P Dow Jones Indices LLC und ihre Tochtergesellschaften sind keine Anlageberater. Die Aufnahme eines Wertpapiers in einen Index stellt keine Empfehlung seitens S&P Dow Jones Indices zum Kauf, Verkauf oder Halten dieses Wertpapiers dar, noch ist diese Aufnahme als Anlageberatung anzusehen.

S&P DOW JONES INDICES GARANTIEREN NICHT DIE EIGNUNG, RICHTIGKEIT, AKTUALITÄT UND/ODER DIE VOLLSTÄNDIGKEIT DES DOW JONES GLOBAL SELECT REAL ESTATE INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ODER DIESBEZÜGLICHER MITTEILUNGEN, INSBESONDERE MÜNDLICHE ODER SCHRIFTLICHE MITTEILUNGEN (ELEKTRONISCHE MITTEILUNGEN INBEGRIFFEN). S&P DOW JONES INDICES UNTERLIEGT KEINEM SCHADENERSATZ ODER KEINER HAFTUNG FÜR ETWAIGE FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER VERZÖGERUNGEN DARIN. S&P DOW JONES INDICES GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK BZW. FÜR EINE BESTIMMTE VERWENDUNG ODER DER ERGEBNISSE AUS, DIE STATE STREET GLOBAL ADVISORS, ANTEILINHABER DES STATE STREETS PDR DOW JONES GLOBAL REAL ESTATE UCITS ETF ODER ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSONEN DURCH DIE VERWENDUNG DES DOW JONES GLOBAL SELECT REAL ESTATE INDEX ODER DARIN ERHALTENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. UNBESCHADET DES VORSTEHENDEN HAFTET S&P DOW JONES INDICES IN KEINEM FALL FÜR MITTELBARE SCHÄDEN, BESONDERE SCHÄDEN, NEBENSCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER FOLGESCHÄDEN, INSBESONDERE ENTGANGENE GEWINNE, HANDELSVERLUSTE, VERLORENE ZEIT ODER VERLORENEM GOODWILL, SELBST WENN ES AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE, OB AUS VERTRAG, UNERLAUBTER HANDLUNG, GEFÄHRDUNGSHAFTUNG ODER ANDERWEITIG. ES GIBT NEBEN DEN LIZENZGEBERN ODER S&P DOW JONES INDICES KEINE DRITTEN, DIE DURCH ZWISCHEN S&P DOW JONES INDICES UND STATE STREET GLOBAL ADVISORS GESCHLOSSENE VERTRÄGE ODER VEREINBARUNGEN BEGÜNSTIGT WERDEN.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von S&P Dow Jones Indices LLC:

Dow Jones Global Select Real Estate Securities Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist S&P Dow Jones Indices LLC im ESMA-Register der Referenzwerte aus Drittstaaten (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als in Einklang mit Artikel 33 der Benchmark-Verordnung anerkannter Administrator eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

State Street SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

Nachtrag Nr. 32

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

State Street SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untieranlageverwalter	State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Februar, Mai, August und Dezember), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für alle Zeichnungen und Rücknahmen: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am ersten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P 500 Low Volatility Index (SP5LVIN).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/strategy/sp-500-low-volatility-index/#overview https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD	
Index Ticker	SP5LVIN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „ Gebühren und Kosten “ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,35 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von US-Aktienwerten mit hoher Marktkapitalisierung (Large Caps), die in der Vergangenheit eine geringe Volatilität aufgewiesen haben.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung der 100 Unternehmen im S&P 500 Index, die die geringste Volatilität aufweisen. Die Indexkomponenten werden im Verhältnis zu ihrer realisierten historischen Volatilität gemessen, d. h. die am wenigsten volatilen Aktien erhalten eine höhere Gewichtung im Index. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Limits erlauben es dem Fonds, Positionen in einzelnen Komponenten des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter können unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es

nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill

Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der

Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf einen bestimmten Markt oder eine geringe Zahl von Aktien, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten dieses Marktes oder dieser Aktien betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Markt oder eine geringe Zahl von Aktien, auf den/die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung US-amerikanischer Aktienmärkte suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen

State Street SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

DER STATE STREET SPDR S&P 500 LOW VOLATILITY UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P 500 LOW VOLATILITY UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P 500 LOW VOLATILITY UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P 500 LOW VOLATILITY INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P 500 LOW VOLATILITY INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET ODER DES STATE STREET SPDR S&P 500 LOW VOLATILITY UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P 500 LOW VOLATILITY INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P 500 LOW VOLATILITY INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P 500 LOW VOLATILITY UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P 500 LOW VOLATILITY UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P 500 LOW VOLATILITY UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P 500 LOW VOLATILITY UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P 500 LOW VOLATILITY UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P 500 LOW VOLATILITY UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P 500 LOW VOLATILITY INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P 500 LOW VOLATILITY INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P 500 LOW VOLATILITY UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P 500 LOW VOLATILITY INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P 500 LOW VOLATILITY INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P 500 LOW VOLATILITY INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (U. A. EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P 500 LOW VOLATILITY INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P 500 Low Volatility Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register der Referenzwerte aus Drittstaaten (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als in Einklang mit Artikel 33 der Benchmark-Verordnung anerkannter Administrator eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR MSCI EMU UCITS ETF

Nachtrag Nr. 33

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR MSCI EMU UCITS ETF ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR MSCI EMU UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	EUR
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Für französische Aktienpläne (PEA) geeignet	Ja
ISIN-Code	IE00B910VR50
Gesamtkostenquote (TER)	Bis zu 0,08 %. Weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „ Gebühren und Kosten “ im Prospekt zu entnehmen.
Ausschüttungspolitik	Alle Erträge und Gewinne werden im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 14.30 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Zeichnungen und Rücknahmen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	MSCI EMU Index (MSDEEMUN).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.msci.com/constituents https://www.msci.com/resources/factsheets/index_fact_sheet/msci-emu-index.pdf

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	18:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von Aktienwerten aus dem Large- und Mid-Cap-Segment (Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung) der Eurozone, die von Unternehmen aus entwickelten Ländern der Eurozone emittiert werden.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung von Aktien aus der Eurozone. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Limits erlauben es dem Fonds, Positionen in einzelnen Komponenten des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert und gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI durch den Fonds beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte (einschließlich Non-Deliverable Forwards) sowie auf Optionsscheine. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom

27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquiden Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken

ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder Region, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung oder aus dieser Region betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung oder Region, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „**Derivate**“ unter „**Zugelassene Anlagen**“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechende negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung von Aktien aus der Eurozone suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

State Street SPDR MSCI EMU UCITS ETF

„MSCI EMU Index“ ist eine Marke der MSCI und deren verbundenen Unternehmen und wurde zur Verwendung durch die State Street Corporation für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR MSCI EMU UCITS ETF wurde von der MSCI nicht im Hinblick auf seine Rechtmäßigkeit oder Eignung überprüft und wird nicht von der MSCI begeben, unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben.

DER State Street SPDR MSCI EMU UCITS ETF WIRD VON MSCI INC. („MSCI“), IHREN KONZERNGESELLSCHAFTEN, IHREN INFORMATIONSLIEFERANTEN ODER ANDEREN MIT DER ZUSAMMENSTELLUNG, BERECHNUNG ODER SCHAFFUNG EINES MSCI INDEX BEFASSTEN ODER VERBUNDENEN PARTEIEN (ZUSAMMEN DIE „MSCI-PARTEIEN“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER BEWORBEN. DIE MSCI-INDIZES STEHEN IM AUSSCHLIESSLICHEN EIGENTUM VON MSCI. MSCI UND DIE NAMEN DER MSCI-INDIZES SIND MARKEN VON MSCI ODER IHRER KONZERNGESELLSCHAFTEN UND WURDEN ZUR VERWENDUNG ZU BESTIMMTEN ZWECKEN DURCH STATE STREET CORPORATION LIZENZIERT. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI EMU UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN AB HINSICHTLICH DER RATSAMKEIT EINER ANLAGE IN FONDS IM ALLGEMEINEN ODER IN DEN STATE STREET SPDR MSCI EMU UCITS ETF IM BESONDEREN ODER DER FÄHIGKEIT EINES MSCI-INDEX, DIE JEWEILIGE AKTIENMARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN. MSCI ODER IHRE KONZERNGESELLSCHAFTEN SIND DIE LIZENZGEBER BESTIMMTER MARKEN, DIENSTLEISTUNGSMARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DER MSCI-INDIZES, DIE VON MSCI OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DES State Street SPDR MSCI EMU UCITS ETF ODER DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI EMU UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WERDEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN UNTERLIEGT EINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DER MSCI-INDIZES DIE BELANGE DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI EMU UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN ZU BERÜCKSICHTIGEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN IST FÜR DIE FESTLEGUNG DES AUSGABEZITPUNKTS, DER AUSGABEPREISE ODER DES AUSGABEUMFANGS DES STATE STREET SPDR MSCI EMU UCITS ETF ODER DER FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER, ODER DES BETRAGES, GEGEN DEN ANTEILE DES STATE STREET SPDR MSCI EMU UCITS ETF ZURÜCKGEGEBEN WERDEN KÖNNEN, VERANTWORTLICH ODER IST DARAN BETEILIGT. WEITERHIN UNTERLIEGT KEINE DER MSCI-PARTEIEN EINER VERPFLICHTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI EMU UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM ANGEBOT DES STATE STREET SPDR MSCI EMU UCITS ETF.

OBWOHL MSCI INFORMATIONEN ZUR AUFNAHME IN DIE MSCI-INDIZES ODER ZUR VERWENDUNG BEI DEREN BERECHNUNG VON QUELLEN ERHÄLT, DIE MSCI ALS VERLÄSSLICH BETRACHTET, GEWÄHRLEISTET KEINE DER MSCI-PARTEIEN DIE ECHTHEIT, RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG AB HINSICHTLICH DER VOM EMITTENTEN DES STATE STREET SPDR MSCI EMU UCITS ETF, DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI EMU UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN DURCH DIE VERWENDUNG EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. KEINE DER MSCI-PARTEIEN HAFTET FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN IN VERBINDUNG MIT MSCI-INDIZES ODER DARIN ENTHALTENEN DATEN. HINSICHTLICH DER MSCI-INDIZES UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT KEINE DER MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNGEN IRGENDNEINER ART AB UND HIERMIT SCHLIESSEN DIE MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICH JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK AUS.

UNBESCHADET DES VORSTEHENDEN HAFTEN DIE MSCI-PARTEIEN IN KEINEM FALL FÜR UNMITTELBARE, MITTELBARE ODER KONKRETE SCHÄDEN, STRAFSCHADENERSATZ, FOLGESCHÄDEN ODER ANDERE SCHÄDEN (EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), SELBST WENN SIE VON DER MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN UNTERRICHTET WURDEN.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von MSCI Limited:

MSCI EMU Index

Zum Datum des Nachtrags ist kein Unternehmen von MSCI Limited im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. MSCI Limited ist und bleibt von der britischen Finanzaufsicht (Financial Conduct Authority, „FCA“) als britischer Benchmark-Administrator zugelassen und reguliert (und ist im Finanzdienstleistungsregister der FCA (Financial Services Register) zu finden); MSCI Limited wird jedoch in Bezug auf die EU als in einem Drittstaat angesiedelter britischer Administrator betrachtet und wird gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung nicht im ESMA-Register eingetragen, sofern nicht und bis die EU eine Äquivalenzentscheidung bezogen auf das Vereinigte Königreich trifft oder bis MSCI der Status „Übernahme“ oder „Anerkennung“ gewährt wird.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF

Nachtrag Nr. 35

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untieranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar, April, Juli und Oktober), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	Für Zeichnungen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag, für Rücknahmen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P Global Dividend Aristocrats Quality Income Index (SPGDASUN).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Halbjährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/dividends-factors/sp-global-dividend-aristocrats-quality-income-index/%23overview https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD	
Index Ticker	SPGDASUN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,45 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung weltweiter Aktien mit hoher Dividendenrendite.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus Industrie- und Schwellenländern in aller Welt. Die Wertpapiere müssen bestimmten Anforderungen an Streuung, Stabilität und Handel genügen und werden anschließend nach der Höhe ihrer Dividenden gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Grenzen erlauben dem Fonds, Positionen bis maximal 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds in vom selben Emittenten ausgegebenen einzelnen Indexkomponenten zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es

nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer

BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um

Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine geringe Zahl von Aktien, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die diese geringe Zahl von Aktien betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die die geringe Zahl von Aktien, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „**Derivate**“ unter „**Zugelassene Anlagen**“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus Industrie- und Schwellenländern in aller Welt suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am

jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

DER STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS QUALITY INCOME INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS QUALITY INCOME INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET ODER DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS QUALITY INCOME INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS QUALITY INCOME INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS QUALITY INCOME INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS QUALITY INCOME INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS QUALITY INCOME INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS QUALITY INCOME INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS QUALITY INCOME INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (U. A. EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS QUALITY INCOME INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P Global Dividend Aristocrats Quality Income Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als Administrator gemäß Artikel 33 der Benchmark-Verordnung eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF

Nachtrag Nr. 36

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P Pan Asia Dividend Aristocrats Index (SPDGPAUN).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Halbjährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/dividends-factors/sp-pan-asia-dividend-aristocrats-index/%23overview https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD	
Index Ticker	SPDGPAUN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „ Gebühren und Kosten “ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,55 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von Aktien mit hoher Dividendenrendite aus der Asien-Pazifik-Region.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus Industrie- und Schwellenländern in Asien. Die Wertpapiere müssen bestimmten Anforderungen an Streuung, Stabilität und Handel genügen und werden anschließend nach der Höhe ihrer Dividenden gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Grenzen erlauben dem Fonds, Positionen bis maximal 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds in vom selben Emittenten ausgegebenen einzelnen Indexkomponenten zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein

„Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen

gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Schwellenländerisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe. **Da der Fonds wesentlich in Schwellenmärkten engagiert ist, sollte eine Anlage im Fonds keinen bedeutenden Anteil am Anlageportfolio darstellen und ist unter Umständen nicht für jeden Anleger geeignet.**

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Region oder eine geringe Zahl von Aktien, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten dieser Region oder diese geringe Zahl von Aktien betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Region oder eine geringe Zahl von Aktien, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus Industrie- und Schwellenländern in Asien suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilkategorie, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

DER STATE STREET SPDR S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET ODER DES STATE STREET SPDR S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (U. A. EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P PAN ASIA DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P Pan Asia Dividend Aristocrats Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als Administrator gemäß Artikel 33 der Benchmark-Verordnung eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF

Nachtrag Nr. 37

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel 8-Fonds, vom Index einbezogenes Nachhaltigkeitsrisiko

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg SASB Scored US Corporate High Yield Ex-Controversies Select Index (I36569US)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored CHF Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF	
Währungsgesich- erter Index	k. A.		Bloomberg SASB Scored US Corporate High Yield Ex-Controversies Select Index (EUR abgesichert)		Bloomberg SASB Scored US Corporate High Yield Ex-Controversies Select Index (GBP abgesichert)		Bloomberg SASB Scored US Corporate High Yield Ex-Controversies Select Index (CHF abgesichert)	
Index Ticker	I36569US		H36569EU		H36569GB		H36569CH	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,30 %		Bis zu 0,35 %		Bis zu 0,35 %		Bis zu 0,35 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für festverzinsliche, auf US-Dollar lautende Hochzins-Unternehmensanleihen.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index ist ein Vergleichsmaßstab für auf US-Dollar lautende festverzinsliche Hochzins-Wertpapiere, der seinen R-Factor™-Wert optimiert, ein Rating zu den Faktoren Umwelt, Soziales und Governance („ESG“), das von State Street Global Advisors® bereitgestellt wird. Auf der Grundlage des Bloomberg US Corporate High Yield Bond Index (der „**U.S. HY Corporate Index**“) wählt der Index Wertpapiere aus, die für den U.S. HY Corporate Index geeignet sind, und zielt dann darauf ab, bestimmte Emittenten auf der Grundlage ihrer ESG-Merkmale auszuschließen. Dabei werden sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten, wie in der Indexmethode beschrieben, berücksichtigt. Anschließend gewichtet der Index die Wertpapiere mithilfe eines Optimierungsprozesses zwecks Maximierung des ESG-Ratings des Portfolios und zur gleichzeitigen Kontrolle des aktiven Gesamtrisikos. Das aktive Gesamtrisiko bezieht sich auf die Abweichung zwischen dem Index und dem U.S. HY Corporate Index.

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet. Nach Anwendung eines Filters, mit dem mindestens 20 % der Wertpapiere aus dem U.S. HY Corporate Index mit dem schlechtesten ESG-Rating eliminiert werden, wird das sich daraus ergebende ESG-Rating des Portfolios voraussichtlich höher sein als das ESG-Rating des Portfolios des U.S. HY Corporate Index.

Die Übernahme dieser Filter und „Best-in-Class“-Kriterien im Index entsprechen den vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Faktoren, wie in den Unterabschnitten „**ESG-Screening**“ und „**Best-in-Class-ESG-Anlagen**“ des Abschnitts „**ESG-Anlagen**“ des Prospekts näher beschrieben. Unternehmen, die nach Einschätzung des Indexanbieters den Prinzipien des United Nations Global Compact entsprechen, gelten als eine gute Unternehmensführung aufweisend. Die wichtigsten methodischen Grenzen werden im Unterabschnitt „**Screening-Risiken**“ des Abschnitts „Anlagerisiken“ dieses Nachtrags beschrieben.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Ab dem Datum dieses Nachtrags berücksichtigen der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf der Fondsebene, um durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachte negative externe Effekte möglichst zu reduzieren.

Dieser Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 SFDR. Weitere Informationen über die ökologischen und sozialen Merkmale sind dem Anhang dieses Nachtrags zu entnehmen.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Taxonomie-Verordnung. Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Fonds ist nicht verpflichtet, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in taxonomiekonforme Anlagen zu investieren.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen, Unternehmensanleihen, ABS-Anleihen, MBS-Anleihen,

CMBS-Anleihen, Pfandbriefe, gesicherte Anleihen und 144A-Wertpapiere sein. 144A-Wertpapiere sind Wertpapiere, die nicht in den Vereinigten Staaten für den Wiederverkauf im Rahmen einer Ausnahmeregelung gemäß Section 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 registriert werden müssen („144A-Wertpapiere“), sie können aber in den Vereinigten Staaten an bestimmte institutionelle Käufer verkauft werden. Die 144A-Wertpapiere werden an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt werden.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Derzeit beteiligt sich der Fonds nicht an einem Wertpapierleihprogramm, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt. Sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung dieser Politik beschließen, werden die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die

zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Risiken im Zusammenhang mit Wertpapieren mit niedrigerem Rating: Schuldtitel von minderer Qualität („High-Yield“- oder „Ramsch“-Anleihen) können mit erheblich höheren Ausfallrisiken verbunden sein als Schuldtitel von höherer Qualität. Sie können illiquide sein, ihr Wert kann heftig schwanken und kurzfristig stark fallen. Schuldtitel von minderer Qualität reagieren tendenziell stärker auf schlechte Nachrichten über den Emittenten, den Markt oder die Wirtschaft im Allgemeinen. **Da der Fonds wesentlich in Anleihen ohne Investment Grade engagiert ist, sollte eine Anlage im Fonds keinen bedeutenden Anteil am Anlageportfolio darstellen und ist unter Umständen nicht für jeden Anleger geeignet.**

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen

Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditrisiken unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters bzw. des Unteranlageverwalters dennoch weiter halten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“ des Prospekts lesen.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko: Die Umsetzung des SFDR erfolgt schrittweise ab dem 10. März 2021 und führt neue Offenlegungspflichten für Teilnehmer der Finanzmärkte ein. Zum Datum dieses Prospekts wurden die technischen Regulierungsstandards zur Umsetzung (Stufe 2) für die SFDR von der Europäischen Kommission verabschiedet und gelten ab dem 1. Januar 2023, aber einige von der SFDR eingeführten Konzepte sind derzeit

nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Der Fonds wurde in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Nachtrag und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Informationen und Klassifizierungen gemäß Artikel 8 Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für kurz laufende, festverzinsliche, auf US-Dollar lautende, hochverzinsliche Unternehmensanleihen suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete mittlere bis hohe Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF (Dist)

State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored EUR Hdg UCITS ETF (Acc)

State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

SFDR-Anhang

ANHANG II

Vorlage – Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung: 549300TT5VW373IGI142

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☐ ☐ **Ja**

☒ ☐ ☒ **Nein**

☐ Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ____%

☐ Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 0 % an nachhaltigen Investitionen

☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ mit einem sozialen Ziel

☐ Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ____%

☒ Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Faktoren sind diejenigen, die zu den R-Factor™-Scores beitragen, die auf Indexkomponenten einschließlich des Bloomberg SASB Scored US Corporate High Yield Ex-Controversies Select Index (der „Index“) angewandt werden. Sie basieren auf einer Bewertung und einem Rating des Indexanbieters für verschiedene ökologische, soziale und Unternehmensführungsmerkmale der Unternehmen im Indexuniversum.

Weitere Informationen über R-Factor™-Scores finden Sie auf der SSGA-Website:
https://www.ssga.com/uk/en_gb/intermediary/ic/capabilities/esg/data-scoring/r-factor-transparent-esg-scoring#:~:text=R%2DFactor%E2%84%A2%20is%20the,materiality%20in%20the%20scoring%20process.

Des Weiteren schließt der Index Emittenten aus, die mit extrem umstrittenen Ereignissen, kontroversen Waffen, Verstößen gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC“), zivilen Schusswaffen, der Förderung und Verstromung von Kraftwerkskohle, der Gewinnung von Ölsanden, der Exploration von arktischem Öl und Gas und Tabakunternehmen in Verbindung gebracht werden.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Die Nachhaltigkeitsindikatoren, mit denen die Erreichung der einzelnen von diesem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale gemessen wird, basieren auf dem Index, der ein ESG-Rating optimiert, das sich aus einem Verantwortungsfaktor („Responsibility Factor“, „R-Factor™“) zusammensetzt. Der R-Faktor™ geht bei der ESG-Bewertung so vor, dass er das gesamte Spektrum der „finanziell wesentlichen“ Messgrößen erfasst, um die langfristigen Nachhaltigkeitstreiber für den Wert in den Bereichen Umwelt, Humankapital, Sozialkapital, Geschäftsmodell, Management und Unternehmensführung zu isolieren.

Die Bewertungsmethode bezieht systematisch Best-in-Class-Daten, einen transparenten Nachhaltigkeitsrahmen und branchenübergreifende finanzielle Wesentlichkeit ein, um einen R-Factor™-Score für jedes Unternehmen zu bestimmen.

Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht anwendbar

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht anwendbar

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht anwendbar

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

✓ Ja,

Der Fonds strebt eine Reduzierung der durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachten negativen externen Effekte an. Er berücksichtigt in diesem Zusammenhang die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Adverse Impacts, „PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er normbasierte ESG-Filter innerhalb des Index anwendet. Der Fonds berücksichtigt insbesondere:



- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze
 - Engagement in umstrittenen Waffen
- Weitere Informationen zu den PAI finden Sie in den regelmäßigen Fondsberichten.

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der Index-Wertentwicklung zu minimieren.

Der Index ist ein Vergleichsmaßstab für auf US-Dollar lautende festverzinsliche Hochzins-Wertpapiere, der seinen R-Factor™-Wert optimiert, ein Rating zu den Faktoren Umwelt, Soziales und Governance („ESG“), das von State Street Global Advisors® bereitgestellt wird. Auf der Grundlage des Bloomberg US Corporate High Yield Bond Index (der „U.S. HY Corporate Index“) wählt der Index Wertpapiere aus, die für den U.S. HY Corporate Index geeignet sind, und zielt dann darauf ab, bestimmte Emittenten auf der Grundlage ihrer ESG-Merkmale auszuschließen. Dabei werden sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten, wie in der Indexmethode beschrieben, berücksichtigt.

Anschließend gewichtet der Index die Wertpapiere mithilfe eines Optimierungsprozesses zwecks Maximierung des ESG-Ratings des Portfolios und zur gleichzeitigen Kontrolle des aktiven Gesamtrisikos. Das aktive Gesamtrisiko bezieht sich auf die Abweichung zwischen dem Index und dem U.S. HY Corporate Index.

Der Anlageverwalter und/oder der Unterverwalter investiert im Namen des Fonds unter Anwendung der im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ des Prospekts näher beschriebenen Strategie stratifizierter Stichproben in erster Linie in die Wertpapiere des Index, und zwar jederzeit in Übereinstimmung mit den im Prospekt dargelegten Anlagebeschränkungen.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index nachzubilden. Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet.

Ökologische und soziale Merkmale werden durch die Verwendung von Filtern beworben, um Wertpapiere auszuschließen, die mit bestimmten Sektoren, Unternehmen oder Praktiken in Verbindung stehen. Sie basieren auf spezifischen ESG-Kriterien und Best-in-Class-ESG-Performance im Vergleich zu Anlageuniversen und/oder im Branchenvergleich, wenn sie anhand objektiver Kriterien innerhalb des Index bewertet werden.

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

Der Fonds schließt Anlagen in Emittenten aus, wie in der Anlagestrategie und den verbindlichen Anforderungen vorstehend dargelegt, sieht jedoch keinen festgelegten Mindestsatz vor, um den Umfang der Anlagen zu reduzieren.

Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?

Unternehmen, die nach Ansicht des Indexanbieters nicht gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen, gelten als Unternehmen mit einer guten Unternehmensführung. Informationen zu den Methoden, die bei der Konstruktion des Index verwendet werden, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von Bloomberg, die unter folgendem Link abrufbar ist:

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index enthalten und auf ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, während der Indexanbieter ESG-Ratings für alle Indexkomponenten anwendet. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen im Sinne der SFDR oder der Taxonomie-Verordnung. Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters 10 % seines Vermögens in Form von Zahlungsmitteln oder Zahlungsmitteläquivalenten und Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden, und die in der nachstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft wurden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen

Die **Anlagestrategie** dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Die Verfahrensweisen einer **guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.



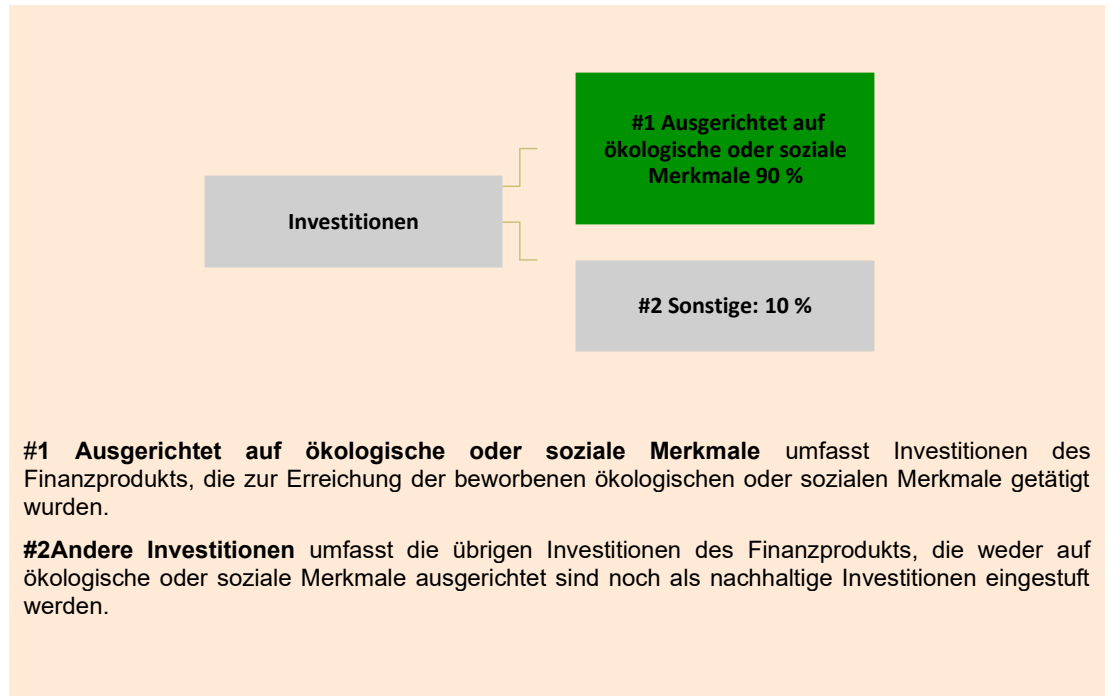
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Merkmale ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Soweit der Fonds ausschließlich zum Zweck der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzt, werden diese nicht zur Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Daher verpflichtet sich der Fonds nicht, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in Anlagen zu investieren, die der Taxonomie-Verordnung entsprechen. Daher ist zu beachten, dass dieser Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Taxonomie-Verordnung nicht berücksichtigt. Es ist daher keine Ausrichtung des Portfolios an der Taxonomie-Verordnung geplant. Aus diesem Grund gilt der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ für keine der Anlagen dieses Fonds und

Es ist keine Ausrichtung an der Taxonomie-Verordnung beabsichtigt.

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles

Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ **Ja:**

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ **Nein**

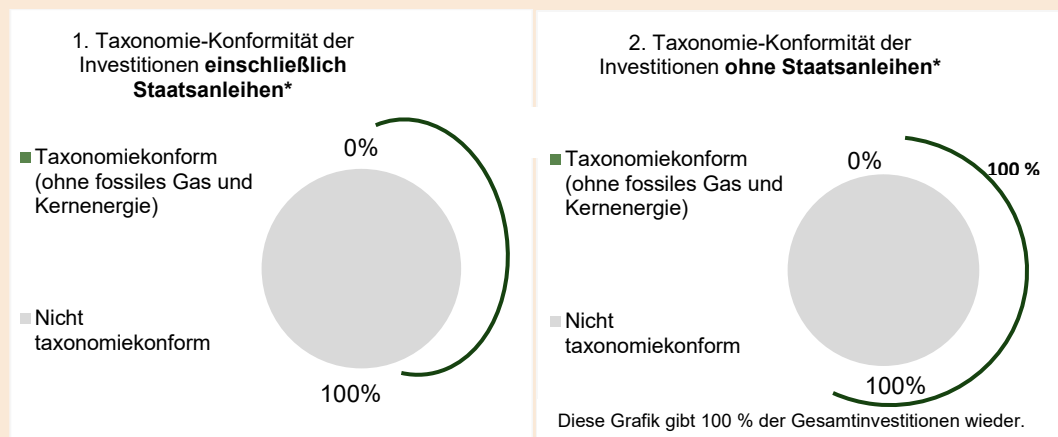
Ermöglichende

Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätig-

keiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



*** Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.**

Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Der Fonds verpflichtet sich zu einem Mindestanteil an Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten.



Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.



Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht anwendbar.



Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen Teil seines Vermögens in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten sowie in Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden und die in der vorstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft werden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.

Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Der Fonds bildet die Wertentwicklung des Bloomberg SASB Scored US Corporate High Yield Ex-Controversies Select Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nach und strebt danach, so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren. Der Index ist eine Benchmark für auf Euro lautende, festverzinsliche Wertpapiere mit Investment Grade, die ihren R-Factor™-Score, ein von State Street Global Advisors® bereitgestelltes Rating (wie oben beschrieben), optimiert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?

Die Indexmethodik sieht eine monatliche Überprüfung und Neugewichtung vor.

Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?

Der Fonds wird monatlich in Übereinstimmung mit der Häufigkeit der Neugewichtung des Index ebenfalls neu gewichtet.

Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?

Der bestimmte Index implementiert Ausschlüsse und Änderungen der Indexgewichtungen gegenüber dem relevanten breiten Marktindex, die von den ESG-Merkmalen der Unternehmen abhängen, wobei sowohl ESG-Ratings als auch die Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten berücksichtigt werden, wie vom Indexanbieter Bloomberg festgelegt. Informationen zur Indexmethodik, die bei der Konstruktion des Index verwendet wird, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von Bloomberg.

Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:

[Anlagen in SPDR Exchange Traded Funds \(ETFs\) \(ssga.com\)](https://www.ssga.com)

State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF

BLOOMBERG® und Bloomberg SASB Scored US Corporate High Yield Ex-Controversies Select Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg SASB Scored US Corporate High Yield Ex-Controversies Select Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg SASB Scored US Corporate High Yield Ex-Controversies Select Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg U.S. High Yield Corporate Scored UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG SASB SCORED US CORPORATE HIGH YIELD EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. HIGH YIELD CORPORATE SCORED UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG SASB SCORED US CORPORATE HIGH YIELD EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG SASB SCORED US CORPORATE HIGH YIELD EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. HIGH YIELD CORPORATE

SCORED UCITS ETF ODER DEM BLOOMBERG SASB SCORED US CORPORATE HIGH YIELD EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg SASB Scored US Corporate High Yield Ex-Controversies Select Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg SASB Scored US Corporate High Yield Ex-Controversies Select Index verwenden.

SASB® vertritt in Bezug darauf, ob ein Emittent in den Bloomberg SASB Scored US Corporate High Yield Ex-Controversies Select Index aufgenommen oder von diesem ausgeschlossen werden sollte, keinen Standpunkt.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 38

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	EUR
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg Euro 0-3 Year Corporate Bond Index (BRC3TREU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	EUR nicht abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		USD abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond USD Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	EUR		GBP		CHF		USD	
Währungsgesich-erter Index	k. A.		Bloomberg Euro 0-3 Year Corporate Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg Euro 0-3 Year Corporate Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg Euro 0-3 Year Corporate Bond Index (USD Hedged)	
Index Ticker	BRC3TREU		H29418GB		H29418CH		H29418US	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,20 %		Bis zu 0,25 %		Bis zu 0,25 %		Bis zu 0,25 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für kurz laufende, festverzinsliche, auf Euro lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für auf kurz laufende auf Euro lautende Unternehmensanleihen. Nur Anleihen mit einer Laufzeit von unter drei Jahren werden aufgenommen, und alle im Index enthaltenen Anleihen bleiben bis zur Fälligkeit im Index. Die Wertpapiere müssen festverzinslich sein, auf Euro lauten und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Die Aufnahme in den Index erfolgt auf Basis der Emissionswährung, nicht auf Basis des Sitzes des Emittenten. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert und gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen

ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen, Unternehmensanleihen, ABS-Anleihen, MBS-Anleihen, CMBS-Anleihen, Pfandbriefe und gesicherte Anleihen sein.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind

kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditschwierigkeiten unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters bzw. des Unteranlageverwalters dennoch weiter halten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für kurz laufende, auf Euro lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF (Dist)

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF (Acc)

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond USD HDG UCITS ETF (Dist)

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond USD HDG UCITS ETF (Acc)

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond GBP HDG UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg Euro 0-3 Year Corporate Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Euro 0-3 Year Corporate Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg Euro 0-3 Year Corporate Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG STERLING 0-3 YEAR CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 0-3 YEAR EURO CORPORATE BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG EURO 0-3 YEAR CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG STERLING 0-3 YEAR CORPORATE BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER

EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTE ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 0-3 YEAR EURO CORPORATE BOND UCITS ETF ODER DEM BLOOMBERG STERLING 0-3 YEAR CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg Euro 0-3 Year Corporate Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg Euro 0-3 Year Corporate Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 39

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year US Corporate Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Trust Company und State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 15:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg U.S. 0-3 Year Corporate Bond Index (BUC3TRUU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond CHF Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs- politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF	
Währungsgesicherter Index	k. A.		Bloomberg U.S. 0-3 Year Corporate Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg U.S. 0-3 Year Corporate Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg U.S. 0-3 Year Corporate Bond Index (CHF Hedged)	
Index Ticker	BUC3TRUU		H29417EU		H29417GB		H29417CH	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,12 %		Bis zu 0,17 %		Bis zu 0,17 %		Bis zu 0,17 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für kurzfristige, festverzinsliche, auf US-Dollar lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für kurz laufende US-Unternehmensanleihen mit Investment Grade. Nur Anleihen mit einer Laufzeit von unter drei Jahren werden aufgenommen, und alle im Index enthaltenen Anleihen bleiben bis zur Fälligkeit im Index. Die Wertpapiere müssen festverzinslich sein, auf US-Dollar lauten, steuerpflichtig und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Die Aufnahme in den Index erfolgt auf Basis der Emissionswährung, nicht auf Basis des Sitzes des Emittenten. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ im Prospekt näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen

ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen, Unternehmensanleihen, ABS-Anleihen, MBS-Anleihen, CMBS-Anleihen, Pfandbriefe und gesicherte Anleihen sein.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von

Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditschwierigkeiten unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter dennoch weiter halten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für kurz laufende, auf US-Dollar lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds, in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 19. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 1. Oktober 2025 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder von den Unteranlageverwaltern festgelegten und dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilten Beträgen entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg U.S. 0-3 Year Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg U.S. 0-3 Year Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg U.S. 0-3 Year Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG U.S. 0-3 YEAR BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 0-3 YEAR U.S. CORPORATE BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG U.S. 0-3 YEAR BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG U.S. 0-3 YEAR BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH

STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 0-3 YEAR U.S. CORPORATE BOND UCITS ETF ODER DEM BLOOMBERG U.S. 0-3 YEAR BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg U.S. 0-3 Year Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg U.S. 0-3 Year Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 40

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg Barclays 1-3+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg Barclays 1-3+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index (I00055US).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		MXN abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond MXN Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF		MXN	
Währungsgesicherter Index	k. A.		Bloomberg U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index (MXN Hedged)	
Index Ticker	I00055US		H00055EU		H00055GB		H00055CH		H00055MX	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,05 %		Bis zu 0,07 %							

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für kurzfristige US-Staatsanleihen.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für US-amerikanische Staatsanleihen und beinhaltet öffentliche Schuldtitle des US-Schatzamts mit Laufzeiten zwischen einem Jahr und bis zu (aber nicht einschließlich) drei Jahren. Bestimmte Sonderemissionen, wie z. B. Serienanleihen einzelstaatlicher und lokaler Emittenten (State and Local Government Series Bonds – SLGs), TIPS und STRIPS, sind ausgeschlossen. Die Wertpapiere müssen festverzinslich und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen

ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, kann es sich unter anderem um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen handeln.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass

der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Untermanager können versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere

Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die die Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Untermanager bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für kurz laufende US-Schatzanleihen (Treasury Bills) suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds, in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter

angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG U.S. 1-3 YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-3 YEAR U.S. TREASURY BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG U.S. 1-3 YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN

BLOOMBERG U.S. 1-3 YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-3 YEAR U.S. TREASURY BOND UCITS ETF ODER DEM BLOOMBERG U.S. 1-3 YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR FTSE EPRA Europe ex UK Real Estate UCITS ETF

Nachtrag Nr. 41

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR FTSE EPRA Europe ex UK Real Estate UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR FTSE EPRA Europe ex UK Real Estate UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	EUR
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März und September), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 14.30 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Der FTSE EPRA Nareit Developed Europe ex UK Index (REXUK).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: http://www.ftse.com/Analytics/factsheets/Home/Search http://www.ftse.com/products/indices/EPRA-NAREIT

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	18:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	EUR nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR FTSE EPRA Europe ex UK Real Estate UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	EUR	
Index Ticker	REXUK	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,30 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für börsennotierte Immobilienpapiere in Europa.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der Index-Wertentwicklung zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für börsennotierte Immobilienpapiere und von Real-Estate-Investment-Trusts („REITS“), die in Europa operieren, nicht aber im Vereinigten Königreich, und deren relevante Aktivitäten definiert sind als der Besitz, die Veräußerung und die Erschließung von ertraggenerierenden Immobilien. Die Wertpapiere werden nach Liquidität, Größe und Umsatz gefiltert und anschließend marktkapitalisierungsgewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese erlauben es ihm, in außergewöhnlichen Marktbedingungen (d.h. ein Emittent stellt einen ungewöhnlich hohen Anteil dieses vom Index gemessenen Marktes dar) Positionen in einzelnen Komponenten des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % bzw. eine Position in einer Komponente des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 35 % des Nettoinventarwerts des Fonds zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert überwiegend in die Indexkomponenten, und zwar anhand einer Nachbildungsstrategie, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ des Prospekts näher beschrieben ist, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außergewöhnlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index erfasst sind, die seines Erachtens jedoch genau den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Indexwertpapiere entsprechen, wie Stamm- und Vorzugsaktien, American Depositary Receipts oder Global Depositary Receipts. Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, werden überwiegend an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt gemäß den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

REITS und REOCs: Der Fonds kann auch in Equity-Real-Estate-Investment-Trusts (Immobilien-Aktiengesellschaften mit börsennotierten Anteilen, „REITS“) und Real-Estate-Operating-Companies (Immobilienbetreiber, „REOCs“) investieren, die weltweit gehandelt werden.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass

der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die

Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf einen bestimmten Sektor oder Titel, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten aus diesem Sektor oder dieses Titels betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Sektor oder Titel, auf den der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Risiken im Zusammenhang mit Real-Estate-Investment-Trusts („REITs“): REITs sind von ganz speziellen Managementkompetenzen abhängig, und ihre Anlagen können stark konzentriert sein. Bei Ausfall kann der REIT seine Rechte als Vermieter unter Umständen nur mit Verzögerung und zu erheblichen Kosten durchsetzen. REITs sind stark auf Cashflows angewiesen. Infolgedessen sind sie besonders kapitalmarktabhängig. Anlagen in REITs unterliegen ferner den Risiken, denen die Aktienmärkte im Allgemeinen ausgesetzt sind.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger

sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des europäischen Marktes für börsennotierte Immobilienpapiere ohne das Vereinigte Königreich suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete hohe Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR FTSE EPRA Europe ex UK Real Estate UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

Der State Street SPDR FTSE EPRA Europe ex UK Real Estate UCITS ETF (der „Fonds“) wurde von State Street Global Advisors in Alleinregie entwickelt. Der Fonds wird in keinerlei Weise durch die London Stock Exchange Group plc und ihre Konzerngesellschaften, einschließlich der FTSE International Limited (gemeinsam die „LSE Gruppe“), die European Public Real Estate Association („EPRA“) oder die National Association of Real Estate Investments Trusts („Nareit“) (zusammen die „lizenzgebenden Parteien“) gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. FTSE Russell ist ein Handelsname von einigen der Gesellschaften der LSE Gruppe.

Alle Rechte an dem FTSE EPRA Nareit Developed Europe ex UK Index (der „Index“) liegen bei den lizenzgebenden Parteien. „FTSE®“ und „FTSE Russell®“ sind Marken der betreffenden Gesellschaft der LSE Gruppe und werden von anderen Gesellschaften der LSE Gruppe unter Lizenz verwendet. „Nareit®“ ist eine Marke von Nareit, „EPRA®“ ist eine Marke von EPRA, und sie werden allesamt von der LSE Gruppe unter Lizenz verwendet.

Der Index wird von oder im Namen der FTSE International Limited oder ihrer Tochtergesellschaft, ihrem Vertreter oder Partner berechnet. Die lizenzgebenden Parteien übernehmen keinerlei Haftung gegenüber anderen Personen, die sich infolge (a) der Nutzung von, des Vertrauens oder eines Fehlers in dem Index oder (b) der Anlage in dem oder des Betriebs des Fonds ergeben. Die lizenzgebenden Parteien erheben weder Ansprüche, Prognosen, Garantien oder Zusicherungen bezüglich der vom Fonds zu erzielenden Ergebnisse noch hinsichtlich der Eignung des Index für den Zweck, zu dem er von State Street Global Advisors eingesetzt wird.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von FTSE International Limited:

FTSE EPRA Nareit Developed Europe ex UK Index.

Zum Datum des Nachtrags ist weder FTSE International Limited noch ein anderes Unternehmen von FTSE Russell im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 42

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited und State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen bar: 15:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg U.S. 10+ Year Corporate Bond Index (LD07TRUU)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD	
Index Ticker	LD07TRUU	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,12 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für langfristige, festverzinsliche, auf US-Dollar lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für lang laufende US-Unternehmensanleihen mit Investment Grade. Es werden nur Anleihen mit einer Laufzeit von mehr als zehn Jahren aufgenommen. Die Wertpapiere müssen festverzinslich sein, auf US-Dollar lauten, steuerpflichtig und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Die Aufnahme in den Index erfolgt auf Basis der Emissionswährung, nicht auf Basis des Sitzes des Emittenten. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ im Prospekt näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen, Unternehmensanleihen, ABS-Anleihen, MBS-Anleihen, CMBS-Anleihen, Pfandbriefe und gesicherte Anleihen sein.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an

den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich

beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditschwierigkeiten unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter dennoch weiter halten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für lang laufende, auf US-Dollar lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete mittlere bis hohe Volatilität des Fonds, in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder von den Unteranlageverwaltern festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg U.S. 10+ Year Corporate Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Bond UCITS ETF wird von Bloomberg Barclays nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg U.S. 10+ Year Corporate Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg U.S. 10+ Year Corporate Bond Index zu berücksichtigen. Barclays ist weder verantwortlich für noch beteiligt an der Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Bond UCITS ETF. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG U.S. 10+ YEAR CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 10+ YEAR U.S. BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG U.S. 10+ YEAR CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG U.S. 10+ YEAR CORPORATE BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT

JEDLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDE SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 10+ YEAR U.S. BOND UCITS ETF ODER BLOOMBERG U.S. 10+ YEAR CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg U.S. 10+ Year Corporate Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg U.S. 10+ Year Corporate Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

Nachtrag Nr. 43

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 15:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg U.S. Government Inflation-Linked Bond Index (BCIT1T)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussmittelkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		MXN abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS Bond MXN Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF		MXN	
Währungsgesich- erter Index	k. A.		Bloomberg U.S. Government Inflation-Linked Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg U.S. Government Inflation-Linked Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg U.S. Government Inflation-Linked Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg U.S. Government Inflation-Linked Bond Index (MXN Hedged)	
Index Ticker	BCIT1T		BCIT1E		BCIT1B		BCIT1H		BCIT1MXH	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,05 %		Bis zu 0,07 %							

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für inflationsgeschützte Staatsanleihen (auch als Treasury Inflation Protected Securities oder „TIPS“) bezeichnet.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für inflationsgeschützte Staatsanleihen in den USA. Die Wertpapiere müssen als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Nominale US-Staatsanleihen, variabel verzinsliche Anleihen und STRIPS sind ausgeschlossen. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des

Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen, Unternehmensanleihen, ABS-Anleihen, MBS-Anleihen, CMBS-Anleihen, Pfandbriefe und gesicherte Anleihen sein.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Untanlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und

Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder einen Markt, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung oder auf diesem Markt betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung oder einen Markt, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im Abschnitt „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind. **Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen:** Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Untanlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für inflationsgeschützte US-Staatsanleihen suchen und bereit sind, die mit einer Anlage

dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg U.S. Government Inflation-Linked Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg U.S. Government Inflation-Linked Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg ist verpflichtet, bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg U.S. Government Inflation-Linked Bond Index die Belange des Emittenten oder der Eigentümer des State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF oder sonstiger Dritter zu berücksichtigen. Weder Bloomberg noch Barclays sind verantwortlich für oder waren an der Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG U.S. GOVERNMENT INFLATION-LINKED BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. TIPS UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG U.S. GOVERNMENT INFLATION-LINKED BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG U.S. GOVERNMENT INFLATION-LINKED BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND

LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. TIPS UCITS ETF ODER BLOOMBERG U.S. GOVERNMENT INFLATION-LINKED BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg U.S. Government Inflation-Linked Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2023. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg U.S. Government Inflation-Linked Bond Index verwenden.

SASB® vertritt in Bezug darauf, ob ein Emittent in den Bloomberg U.S. Government Inflation-Linked Bond Index aufgenommen oder von diesem ausgeschlossen werden sollte, keinen Standpunkt.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR MSCI Japan UCITS ETF

Nachtrag Nr. 44

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR MSCI Japan UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR MSCI Japan UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	JPY
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Alle Erträge und Gewinne werden im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter und ungesicherter Anteilklassen gegen Barzahlung [und Sachwerte]: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	MSCI Japan Index („der Index“) (Ticker: M7JP).
Häufigkeit des Rebalancing	Index- Vierteljährlich
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.msci.com/index-licensing https://www.msci.com/constituents https://www.msci.com/documents/10199/b3ee6464-f705-4d65-81a0-d8756607cf9f

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Letztgehandelte Kurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilstklassen

Art der Anteilsklasse	JPY nicht abgesichert	EUR nicht abgesichert	USD abgesichert	EUR abgesichert	GBP abgesichert	CHF abgesichert
Name	State Street SPDR MSCI Japan UCITS ETF	State Street SPDR MSCI Japan EUR UCITS ETF	State Street SPDR MSCI Japan USD Hdg UCITS ETF	State Street SPDR MSCI Japan EUR Hdg UCITS ETF	State Street SPDR MSCI Japan GBP Hdg UCITS ETF	State Street SPDR MSCI Japan CHF Hdg UCITS ETF
Ausschüttungs-politik*	Acc	Acc	Acc	Acc	Acc	Acc
Währung der Anteils-klasse	JPY	EUR	USD	EUR	GBP	CHF
Währungsgesicherter Index	k. A.	MSCI Japan EUR Index	MSCI Japan 100% Hedged to USD Index	MSCI Japan 100% Hedged to EUR Index	MSCI Japan 100% Hedged to GBP Index	MSCI Japan 100% Hedged to CHF Index
Index Ticker	M7JP	MSDEJNN	M1CXB MJH	MXJPHEUR	M0JPHGBP	M0JPHCHF
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „ Gebühren und Kosten “ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,12 %		Bis zu 0,17 %			

*Ausschüttungspolitik: „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des japanischen Aktienmarktes.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren. Der Index ist ein am Streubesitz orientierter nach Marktkapitalisierung gewichteter Index, der die Wertentwicklung von Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung (Large- und Mid-Cap-Segment) des japanischen Marktes messen soll und etwa 85% der am Streubesitz orientierten Marktkapitalisierung in Japan abdeckt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern (JPY). Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („**währungsgesicherter Index**“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Optimierungsstrategie, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt.

Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig

abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI durch den Fonds beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte (einschließlich Non-Deliverable Forwards) sowie auf Optionsscheine. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem

Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder einen Markt, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung oder auf diesem Markt betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung oder einen Markt, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt

„Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des japanischen Aktienmarktes suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete hohe Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR MSCI Japan UCITS ETF (Acc)
State Street SPDR MSCI Japan EUR Hdg UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten, dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilten Beträgen entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR MSCI Japan UCITS ETF

„MSCI Japan Index“ ist eine Marke von MSCI und ihren Konzerngesellschaften und wurde zur Verwendung durch die State Street Corporation für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR MSCI Japan UCITS ETF wurde von der MSCI nicht im Hinblick auf seine Rechtmäßigkeit oder Eignung überprüft und wird nicht von der MSCI begeben, unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben.

DER STATE STREET SPDR MSCI JAPAN UCITS ETF WIRD VON MSCI INC. („MSCI“), IHREN KONZERNGESELLSCHAFTEN, IHREN INFORMATIONSLIEFERANTEN ODER ANDEREN MIT DER ZUSAMMENSTELLUNG, BERECHNUNG ODER SCHAFFUNG EINES MSCI INDEX BEFASSTEN ODER VERBUNDENEN PARTEIEN (ZUSAMMEN DIE „MSCI-PARTEIEN“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER BEWORBEN. DIE MSCI-INDIZES STEHEN IM AUSSCHLIESSLICHEN EIGENTUM VON MSCI. MSCI UND DIE NAMEN DER MSCI-INDIZES SIND MARKEN VON MSCI ODER IHRER KONZERNGESELLSCHAFTEN UND WURDEN ZUR VERWENDUNG ZU BESTIMMTEN ZWECKEN DURCH STATE STREET CORPORATION LIZENZIERT. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI JAPAN UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN AB HINSICHTLICH DER RATSAMKEIT EINER ANLAGE IN FONDS IM ALLGEMEINEN ODER IN DEN STATE STREET SPDR MSCI JAPAN UCITS ETF IM BESONDEREN ODER DER FÄHIGKEIT EINES MSCI-INDEX, DIE JEWEILIGE AKTIENMARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN. MSCI ODER IHRE KONZERNGESELLSCHAFTEN SIND DIE LIZENZGEBER BESTIMMTER MARKEN, DIENSTLEISTUNGSMARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DER MSCI-INDIZES, DIE VON MSCI OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DES STATE STREET SPDR MSCI JAPAN UCITS ETF ODER DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI JAPAN UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WERDEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN UNTERLIEGT EINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DER MSCI-INDIZES DIE BELANGE DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI JAPAN UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN ZU BERÜCKSICHTIGEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN IST FÜR DIE FESTLEGUNG DES AUSGABEZEITPUNKTS, DER AUSGABEPREISE ODER DES AUSGABEUMFANGS DES STATE STREET SPDR MSCI JAPAN UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER, ODER DES BETRAGES, GEGEN DEN ANTEILE DES STATE STREET SPDR MSCI JAPAN UCITS ETF ZURÜCKGEGEBEN WERDEN KÖNNEN, VERANTWORTLICH ODER IST DARAN BETEILIGT. WEITERHIN UNTERLIEGT KEINE DER MSCI-PARTEIEN EINER VERPFLICHTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI JAPAN UCITS ETF.

OBWOHL MSCI INFORMATIONEN ZUR AUFNAHME IN DIE MSCI-INDIZES ODER ZUR VERWENDUNG BEI DEREN BERECHNUNG VON QUELLEN ERHÄLT, DIE MSCI ALS VERLÄSSLICH BETRACHTET, GEWÄHRLEISTET KEINE DER MSCI-PARTEIEN DIE ECHTHEIT, RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG AB HINSICHTLICH DER VOM EMITTENTEN DES STATE STREET SPDR MSCI JAPAN UCITS ETF, DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI JAPAN UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN DURCH DIE VERWENDUNG EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. KEINE DER MSCI-PARTEIEN HAFTET FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN IN VERBINDUNG MIT MSCI-INDIZES ODER DARIN ENTHALTENEN DATEN. HINSICHTLICH DER MSCI-INDIZES UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT KEINE DER MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNGEN IRGEND EINER ART AB UND HIERMIT SCHLIESSEN DIE MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICH JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK AUS. UNBESCHADET DES VORSTEHENDEN HAFTEN DIE MSCI-PARTEIEN IN KEINEM FALL FÜR UNMITTELBARE, MITTELBARE ODER KONKRETE SCHÄDEN, STRAFSCHADENERSATZ, FOLGESCHÄDEN ODER ANDERE SCHÄDEN (EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), SELBST WENN SIE VON DER MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN UNTERRICHTET WURDEN.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von MSCI Limited:

MSCI Japan Index.

Zum Datum dieses Nachtrags ist und bleibt kein Unternehmen von MSCI Limited von der britischen Finanzaufsicht (Financial Conduct Authority; „FCA“) als britischer Benchmark-Administrator zugelassen und reguliert (und ist im Finanzdienstleistungsregister der FCA (Financial Services Register) zu finden); MSCI Limited wird jedoch in Bezug auf die EU als in einem Drittstaat angesiedelter britischer Administrator betrachtet und wird gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung nicht im ESMA-Register eingetragen, sofern nicht und bis die EU eine Äquivalenzentscheidung bezogen auf das Vereinigte Königreich trifft oder bis MSCI der Status „Übernahme“ oder „Anerkennung“ gewährt wird.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg 3-7 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 45

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg Barclays 3-7+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg Barclays 3-7+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg U.S. 3-7 Year Treasury Bond Index (I15682US).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg 3-7 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		MXN abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 3-7 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 3-7 Year U.S. Treasury Bond EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 3-7 Year U.S. Treasury Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 3-7 Year U.S. Treasury Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 3-7 Year U.S. Treasury Bond MXN Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF		MXN	
Währungsgesich-erter Index	k. A.		Bloomberg U.S. 3-7 Year Treasury Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg U.S. 3-7 Year Treasury Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg U.S. 3-7 Year Treasury Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg U.S. 3-7 Year Treasury Bond Index (MXN Hedged)	
Index Ticker	I15682US		H15682EU		H15682GB		H15682CH		H15682MX	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,05 %		Bis zu 0,07 %							

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für US-Staatsanleihen mit mittleren Laufzeiten.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für US-amerikanische Staatsanleihen und beinhaltet öffentliche Schuldtitel des US-Schatzamts mit Laufzeiten zwischen drei und bis zu (aber nicht einschließlich) sieben Jahren. Bestimmte Sonderemissionen, wie z. B. Serienanleihen einzelstaatlicher und lokaler Emittenten (State and Local Government Series Bonds – SLGs), TIPS und STRIPS, sind ausgeschlossen. Die Wertpapiere müssen festverzinslich und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungs gesicherten Versionen des Index („währungs gesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters

entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, handelt es sich ausschließlich um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann derivative Finanzinstrumente („DFI“) zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der

Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder einen Markt, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung oder auf diesem Markt betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die die Währung oder einen Markt, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann derivative Instrumente zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im Abschnitt „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von derivativen Instrumenten durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für Schuldtitel des US-Schatzamts (US Treasuries) mit mittleren Laufzeiten und Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds, in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 3-7 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR Bloomberg 3-7 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

BLOOMBERG® und Bloomberg U.S. 3-7 Year Treasury Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 3-7 U.S. Year Treasury Bond UCITS ETF wird von Bloomberg oder Barclays nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 3-7 U.S. Year Treasury Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 3-7 U.S. Year Treasury Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg U.S. 3-7 Year Treasury Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 3-7 U.S. Year Treasury Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 3-7 U.S. Year Treasury Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg U.S. 3-7 Year Treasury Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 3-7 U.S. Year Treasury Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 3-7 U.S. Year Treasury Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 3-7 U.S. Year Treasury Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG U.S. 3-7 YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 3-7 U.S. YEAR TREASURY BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG U.S. 3-7 YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG U.S. 3-7 YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 3-7 YEAR U.S. TREASURY BOND UCITS ETF ODER DEM BLOOMBERG 3-7 YEAR U.S. TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg U.S. 3-7 Year Treasury Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg U.S. 3-7 Year Treasury Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 47

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg Barclays 7-10+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg Barclays 7-10+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg U.S. 7-10 Year Treasury Bond Index (I00058US).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		MXN abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond MXN Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF		MXN	
Währungsgesich- erter Index	k. A.		Bloomberg U.S. 7-10 Year Treasury Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg U.S. 7-10 Year Treasury Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg U.S. 7-10 Year Treasury Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg U.S. 7-10 Year Treasury Bond Index (MXN Hedged)	
Index Ticker	I00058US		H00058EU		H00058GB		H00058CH		H00058MX	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,05 %		Bis zu 0,07 %							

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für US-Staatsanleihen mit mittleren Laufzeiten.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für US-amerikanische Staatsanleihen und beinhaltet öffentliche Schuldtitel des US-Schatzamts mit Laufzeiten zwischen sieben und bis zu (aber nicht einschließlich) zehn Jahren. Bestimmte Sonderemissionen, wie z. B. Serienanleihen einzelstaatlicher und lokaler Emittenten (State and Local Government Series Bonds – SLGs), TIPS und STRIPS, sind ausgeschlossen. Die Wertpapiere müssen festverzinslich und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten

und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, handelt es sich ausschließlich um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass

der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Untanlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen,

während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder einen Markt, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung oder auf diesem Markt betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die die Währung oder einen Markt, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im Abschnitt „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Untanlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger

sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für Schuldtitel des US-Schatzamts (US Treasuries) mit mittleren Laufzeiten und Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds, in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF(Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg U.S. 7-10 Year Treasury Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg U.S. 7-10 Year Treasury Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg U.S. 7-10 Year Treasury Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 7-10 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG U.S. 7-10 YEAR TREASURY INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWIEGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 7-10 YEAR U.S. TREASURY BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG U.S. 7-10 YEAR TREASURY INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG U.S. 7-10 YEAR TREASURY INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH

NOCH STILLSCHWIEGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 7-10 YEAR U.S. TREASURY BOND UCITS ETF ODER DEM BLOOMBERG U.S. 7-10 YEAR TREASURY INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg U.S. 7-10 Year Treasury Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg U.S. 7-10 Year Treasury Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 48

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg Barclays 10+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg Barclays 10+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untieranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 15:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg U.S. 10+ Year Treasury Bond Index (I00050US).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

Anteilstklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		MXN hedged	
Name	State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury Bond EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury Bond CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury Bond MXN Hdg UCITS ETF	
Aus-schüttungs-politik*	D i s t	Acc	D i s t	Acc	D i s t	Acc	D i s t	Acc	D i s t	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF		MXN	
Währungsgesic herter Index	k. A.		Bloomberg U.S. 10+ Year Treasury Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg U.S. 10+ Year Treasury Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg U.S. 10+ Year Treasury Bond Index (CHF Hedged)		Bloomberg U.S. 10+ Year Treasury Bond Index (MXN Hedged)	
Index Ticker	I00050US		H00050EU		H00050GB		H00050CH		H00050MX	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,05 %		Bis zu 0,07 %							

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für langfristige US-Staatsanleihen.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für US-amerikanische Staatsanleihen und beinhaltet öffentliche Schuldtitel des US-Schatzamts mit Laufzeiten von mehr als zehn Jahren. Bestimmte Sonderemissionen, wie z. B. Serienanleihen einzelstaatlicher und lokaler Emittenten (State and Local Government Series Bonds – SLGs), TIPS und STRIPS, sind ausgeschlossen. Die Wertpapiere müssen festverzinslich und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten

und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, handelt es sich ausschließlich um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass

der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder einen Markt, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung

oder auf diesem Markt betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die die Währung oder einen Markt, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im Abschnitt „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der

Wertentwicklung des Marktes für langfristige US-Schatzanleihen mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete mittlere bis hohe Volatilität des Fonds, in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF (Dist); und
State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg U.S. 10+ Year Treasury Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury UCITS ETF wird von Bloomberg Barclays nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg U.S. 10+ Year Treasury Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg U.S. 10+ Year Treasury Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 10+ Year U.S. Treasury UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG U.S. 10+ YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 10+ YEAR U.S. TREASURY UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG U.S. 10+ YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG U.S. 10+ YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 10+ YEAR U.S. TREASURY BOND UCITS ETF ODER DEM BLOOMBERG U.S. 10+ YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL: Bloomberg U.S. 10+ Year Treasury Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg U.S. 10+ Year Treasury Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 53

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	EUR
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Zeichnungen und Rücknahmen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg Euro 10+ Year Treasury Bond Index (LET0TREU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussmittelkurse für alle Wertpapiere
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	EUR nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	EUR	
Index Ticker	LET0TREU	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,15 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für langfristige Staatsanleihen der Eurozone.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für Staatsanleihen der Eurozone und beinhaltet Anleihen mit Laufzeiten von mehr als zehn Jahren. Die Wertpapiere müssen festverzinslich und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, handelt es sich ausschließlich um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes

Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank und Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International

and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder Region, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung oder aus dieser Region betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die die Währung oder Region, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und

anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Märkte für lang laufende Staatsanleihen der Eurozone mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete mittlere bis hohe Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa

30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF

BLOOMBERG® und Bloomberg Euro 10+ Year Treasury Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF wird von Bloomberg oder Barclays nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Euro 10+ Year Treasury Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg Euro 10+ Year Treasury Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 10+ Year Euro Government Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG EURO 10+ YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 10+ YEAR EURO GOVERNMENT BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG EURO 10+ YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG EURO 10+ YEAR TREASURY

BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEDLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 10+ YEAR EURO GOVERNMENT BOND UCITS ETF ODER BLOOMBERG EURO 10+ YEAR TREASURY BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg Euro 10+ Year Treasury Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg Euro 10+ Year Treasury Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 54

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteraanlageverwalter	State Street Global Advisors Limited und State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 15:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg U.S. Intermediate Corporate Bond Index (der „Index“) (LD06TRUU)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond CHF Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs- politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF	
Währungsgesich- erter Index	k. A.		Bloomberg U.S. Intermediate Corporate Bond Index (EUR Hedged)		Bloomberg U.S. Intermediate Corporate Bond Index (GBP Hedged)		Bloomberg U.S. Intermediate Corporate Bond Index (CHF Hedged)	
Index Ticker	LD06TRUU		LD06TREH		LD06TRGH		LD06TRCH	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,12 %		Bis zu 0,17 %		Bis zu 0,17 %		Bis zu 0,17 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für festverzinsliche, auf US-Dollar lautende Unternehmensanleihen mit mittleren Laufzeiten und Investment Grade.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für US-Unternehmensanleihen mit mittleren Laufzeiten und Investment Grade. Es werden nur Anleihen mit Laufzeiten von ein bis zehn Jahren aufgenommen. Die Wertpapiere müssen festverzinslich sein, auf US-Dollar lauten, steuerpflichtig und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Die Aufnahme in den Index erfolgt auf Basis der Emissionswährung, nicht auf Basis des Sitzes des Emittenten.

Es werden abgesicherte Klassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten (USD) zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die währungsgesicherten Klassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die währungsgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („**währungsgesicherter Index**“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ im Prospekt näher beschrieben, mindestens 90 % des Fondsvermögens in Staatsanleihen, Anleihen von staatlichen Stellen und Unternehmensanleihen, die Indexkomponenten sind, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Wert, das Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, um in den währungsgesicherten Klassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine währungsgesicherte Klasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse

wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, handelt es sich ausschließlich um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen sowie Unternehmensanleihen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann derivative Finanzinstrumente („DFI“) zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften.

Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu

einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Derivaterisiko: Der Fonds kann derivative Instrumente zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von derivativen Instrumenten durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder einen Markt, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung oder auf diesem Markt betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung oder einen Markt, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine

Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditschwierigkeiten unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters und/oder der Untereinlageverwalter dennoch weiter halten.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder die Untereinlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für auf US-Dollar lautende Unternehmensanleihen mit mittleren Laufzeiten und Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds, in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder von den Untereinlageverwaltern festgelegten und dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilten Beträgen entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

BLOOMBERG® und Bloomberg U.S. Intermediate Corporate Bond Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg U.S. Intermediate Corporate Bond Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg U.S. Intermediate Corporate Bond Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG U.S. INTERMEDIATE CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-10 YEAR U.S. CORPORATE BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG U.S. INTERMEDIATE CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG U.S. INTERMEDIATE CORPORATE BOND INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNENTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND

SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-10 YEAR U.S. CORPORATE BOND UCITS ET ODER DEM BLOOMBERG U.S. INTERMEDIATE CORPORATE BOND INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg U.S. Intermediate Corporate Bond Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg U.S. Intermediate Corporate Bond Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

State Street SPDR MSCI World UCITS ETF

Nachtrag Nr. 55

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR MSCI World UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR MSCI World UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Februar, Mai, August und Dezember jeden Jahres), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	Für Zeichnungen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag, für Rücknahmen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	MSCI World Index (NDDUWI)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.msci.com/constituents https://www.msci.com/resources/factsheets/index_fact_sheet/msci-world-index.pdf

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR MSCI World UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		USD abgesichert		CHF abgesichert	
Name	State Street SPDR MSCI World UCITS ETF		State Street SPDR MSCI World EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR MSCI World GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR MSCI World USD Hdg UCITS ETF		State Street SPDR MSCI World CHF Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		USD		CHF	
Währungsgesic herter Index	k. A.		MSCI World 100% Hedged to EUR Index		MSCI World 100% Hedged to GBP Index		MSCI World 100% Hedged to USD Index		MSCI World 100% Hedged to CHF Index	
Index Ticker	NDDUWI		M0WOHEUR		M0WOHGBP		HU124669		M0WOHCHF	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,12 %		Bis zu 0,17 %							

*Ausschüttungspolitik: „Acc“ = Thesaurierende Anteile; „Dist“ = Ausschüttende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von Aktienwerten aus dem Large- und Mid-Cap-Segment (Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung) in Industrieländern weltweit.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index verfolgt die Wertentwicklung von Aktien großer und mittlerer Marktkapitalisierung aus Industrieländern. Der Index deckt rund 85% der am Streubesitz orientierten Marktkapitalisierung in jedem Land ab. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („**währungsgesicherter Index**“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Optimierungsstrategie, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene

Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI durch den Fonds beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte (einschließlich Non-Deliverable Forwards) sowie auf Optionsscheine. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen**“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „**Risiko der Wertpapierleihe**“ im Abschnitt „**Risikoinformationen**“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von

Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die

Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechende negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung von Aktien großer und mittelgroßer

Unternehmen aus Industrieländern suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR MSCI World UCITS ETF (Acc)
State Street SPDR MSCI World UCITS ETF (Dist)
State Street SPDR MSCI World EUR Hdg UCITS ETF (Acc)
State Street SPDR MSCI World GBP Hdg UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der **„Erstausgabezeitraum“**). Der Erstausgabepreis wird in etwa 10 in der Währung der jeweiligen Anteilkasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

DER FONDS WIRD VON MSCI INC. („MSCI“), IHREN KONZERNGESELLSCHAFTEN, IHREN INFORMATIONSLIEFERANTEN ODER ANDEREN MIT DER ZUSAMMENSTELLUNG, BERECHNUNG ODER SCHAFFUNG EINES MSCI INDEX BEFASSTEN ODER VERBUNDENEN PARTEIEN (ZUSAMMEN DIE „MSCI-PARTEIEN“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER BEWORBEN. DIE MSCI-INDIZES STEHEN IM AUSSCHLIESSLICHEN EIGENTUM VON MSCI. MSCI UND DIE NAMEN DER MSCI-INDIZES SIND MARKEN VON MSCI ODER IHRER KONZERNGESELLSCHAFTEN UND WURDEN ZUR VERWENDUNG ZU BESTIMMTEN ZWECKEN DURCH STATE STREET CORPORATION LIZENZIERT. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI WORLD UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN AB HINSICHTLICH DER RATSAMKEIT EINER ANLAGE IN FONDS IM ALLGEMEINEN ODER IN DEN STATE STREET SPDR MSCI WORLD UCITS ETF IM BESONDEREN ODER DER FÄHIGKEIT EINES MSCI-INDEX, DIE JEWEILIGE AKTIENMARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN. MSCI ODER IHRE KONZERNGESELLSCHAFTEN SIND DIE LIZENZGEBER BESTIMMTER MARKEN, DIENSTLEISTUNGSMARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DER MSCI-INDIZES, DIE VON MSCI OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DES STATE STREET SPDR MSCI WORLD UCITS ETF ODER DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI WORLD UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WERDEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN UNTERLIEGT EINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DER MSCI-INDIZES DIE BELANGE DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES STATE STREET SPDR MSCI WORLD UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN ZU BERÜCKSICHTIGEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN IST FÜR DIE FESTLEGUNG DES AUSGABEZITPUNKTS, DER AUSGABEPREISE ODER DES AUSGABEUMFANGS DES STATE STREET SPDR MSCI WORLD UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER, ODER DES BETRAGES, GEGEN DEN ANTEILE DES STATE STREET SPDR MSCI WORLD UCITS ETF ZURÜCKGEGEBEN WERDEN KÖNNEN, VERANTWORTLICH ODER IST DARAN BETEILIGT. WEITERHIN UNTERLIEGT KEINE DER MSCI-PARTEIEN EINER VERPFLICHTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI WORLD UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM ANGEBOT DES STATE STREET SPDR MSCI WORLD UCITS ETF.

OBWOHL MSCI INFORMATIONEN ZUR AUFNAHME IN DIE MSCI-INDIZES ODER ZUR VERWENDUNG BEI DEREN BERECHNUNG VON QUELLEN ERHÄLT, DIE MSCI ALS VERLÄSSLICH BETRACHTET, GEWÄHRLEISTET KEINE DER MSCI-PARTEIEN DIE ECHTHEIT, RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG AB HINSICHTLICH DER VOM EMITTENTEN DES STATE STREET SPDR MSCI WORLD UCITS ETF, DEN GESELLSCHAFTERN DES STATE STREET SPDR MSCI WORLD UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN DURCH DIE VERWENDUNG EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. KEINE DER MSCI-PARTEIEN HAFTET FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN IN VERBINDUNG MIT MSCI-INDIZES ODER DARIN ENTHALTENEN DATEN. HINSICHTLICH DER MSCI-INDIZES UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT KEINE DER MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNGEN IRGEND EINER ART AB UND HIERMIT SCHLIESSEN DIE MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICH JEDLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK AUS. UNBESCHADET DES VORSTEHENDEN HAFTEN

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

DIE MSCI-PARTEIEN IN KEINEM FALL FÜR UNMITTELBARE, MITTELBARE ODER KONKRETE SCHÄDEN, STRAFSCHADENERSATZ, FOLGESCHÄDEN ODER ANDERE SCHÄDEN (EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), SELBST WENN SIE VON DER MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN UNTERRICHTET WURDEN.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von MSCI Limited:

MSCI World Index.

Zum Datum des Nachtrags ist kein Unternehmen von MSCI Limited im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. MSCI Limited ist und bleibt von der britischen Finanzaufsicht (Financial Conduct Authority; „FCA“) als britischer Benchmark-Administrator zugelassen und reguliert (und ist im Finanzdienstleistungsregister der FCA (Financial Services Register) zu finden); MSCI Limited wird jedoch in Bezug auf die EU als in einem Drittstaat angesiedelter britischer Administrator betrachtet und wird gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung nicht im ESMA-Register eingetragen, sofern nicht und bis die EU eine Äquivalenzentscheidung bezogen auf das Vereinigte Königreich trifft oder bis MSCI der Status „Übernahme“ oder „Anerkennung“ gewährt wird.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

Nachtrag Nr. 56

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Limited
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, monatliche Ausschüttung des Ertrags, außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg US Treasury Bills 1-3 Month Index (LD12TRUU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		MXN abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill MXN Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF		MXN	
Währungsgesicherter Index	k. A.		Bloomberg US Treasury Bills 1-3 Month Index (EUR Hedged)		Bloomberg US Treasury Bills 1-3 Month Index (GBP Hedged)		Bloomberg US Treasury Bills 1-3 Month Index (CHF Hedged)		Bloomberg US Treasury Bills 1-3 Month Index (MXN Hedged)	
Index Ticker	LD12TRUU		H00078EU		H00078GB		H00078CH		H00078MX	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,05 %									

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel:

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, den Anlegern eine Gesamtrendite unter Berücksichtigung von Erträgen und Veräußerungsgewinnen zu bieten, die im Allgemeinen die Rendite des Bloomberg US Treasury Bills 1-3 Month Index widerspiegelt.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für öffentliche Schuldtitel des US-Schatzamts mit Laufzeiten zwischen einem Monat und bis zu (aber nicht einschließlich) drei Monaten. Bestimmte Sonderemissionen, wie z. B. Serienanleihen einzelstaatlicher und lokaler Emittenten (State and Local Government Series Bonds – SLGs), TIPS und STRIPS, sind ausgeschlossen. Die Wertpapiere müssen festverzinslich und als Investment Grade eingestuft sein, wie in der Indexmethodik festgelegt. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte

für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Wichtiger Hinweis: Der Fonds ist kein Geldmarktfonds und unterliegt daher nicht den Anforderungen der Zentralbank an Geldmarktfonds oder der Verordnung (EU) 2017/1131 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 14. Juni 2017 (einschließlich Laufzeit- und Qualitätsbeschränkungen). Diese sollen es Geldmarktfonds ermöglichen, einen stabilen Nettoinventarwert zu halten. Der Fonds strebt nicht danach, einen stabilen Nettoinventarwert je Anteil von USD 1 je Anteil zu halten.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, kann es sich unter anderem um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen handeln.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der

Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der

Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die die Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im Abschnitt „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der

Wertentwicklung des Marktes für kurz laufende US Treasury Bills suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds, in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR® Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF (Acc)

State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill MXN Hdg UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 100 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg US Treasury Bills 1-3 Month Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg Bloomberg US Treasury Bills 1-3 Month Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg US Treasury Bills 1-3 Month Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG US TREASURY BILLS 1-3 MONTH INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-3 MONTH T-BILL UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG US TREASURY BILLS 1-3 MONTH INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG US TREASURY BILLS 1-3 MONTH INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH

STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-3 MONTH T-BILL UCITS ETF ODER BLOOMBERG US TREASURY BILLS 1-3 MONTH INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg US Treasury Bills 1-3 Month Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg US Treasury Bills 1-3 Month Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR S&P 500 Leaders UCITS ETF

Nachtrag Nr. 57

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P 500 Leaders UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P 500 Leaders UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März, Juni, September und Dezember jedes Jahr), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem alleinigen Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel 8-Fonds, vom Index einbezogenes Nachhaltigkeitsrisiko

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag.
	Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen: 14.30 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag.
	Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am ersten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P 500 Scored & Screened Leaders Index (SPXESLUN).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Jährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/sustainability/sp-500-scored-and-screened-leaders-index/#overview/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P 500 Leaders UCITS ETF		State Street SPDR S&P 500 Leaders EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR S&P 500 Leaders GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR S&P 500 Leaders CHF Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs- politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF	
Währungsgesicherter Index	k. A.		S&P 500 Scored & Screened Leaders EUR Dynamic Hedged Index		S&P 500 Scored & Screened Leaders GBP Dynamic Hedged Index		S&P 500 Scored & Screened Leaders CHF Dynamic Hedged Index	
Index Ticker	SPXESLUN		SP5LEDEN		SP5LEDGN		SP5LEDCN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,03 %		Bis zu 0,05 %					

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von Large-Cap-Werten am US-amerikanischen Aktienmarkt.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung der 500 nach ihrer Marktkapitalisierung größten Unternehmen des US-Aktienmarktes, bekannt als S&P 500 Index (der „Standardindex“), wobei Wertpapiere aufgrund ihrer ESG-Merkmale ausgeschlossen werden, und zwar sowohl im Hinblick auf ihr ESG-Rating als auch auf ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten (in der Indexmethodik beschrieben). Der Index zielt auf 50 % der streubesitzbereinigten Marktkapitalisierung jeder Branchengruppe des Global Industry Classification Standard (GICS) innerhalb des Standardindex ab, wobei ein S&P DJI ESG-Score als definierendes Merkmal verwendet wird. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Faktoren sind diejenigen, die zu den S&P DJI ESG-Scores beitragen, die auf einer Bewertung und einem Rating des Indexanbieters für verschiedene ökologische, soziale und Unternehmensführungsmerkmale für Unternehmen im Indexuniversum beruhen.

Weitere Informationen zu den S&P DJI ESG-Scores finden Sie in der Methodik zu den S&P DJI ESG-Scores:

<https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-dji-esg-score.pdf>

Die Übernahme dieser Filter im Index entspricht den vom Fonds durch das Anstreben der Indexnachbildung beworbenen ökologischen und sozialen Faktoren. Die Anwendung dieser Maßstäbe wird in den Unterabschnitten „ESG-Screening“ und „Best-in-Class-ESG-Anlagen“ des Abschnitts „ESG-Anlagen“ des Prospekts näher beschrieben. Unternehmen, die vom Indexanbieter als konform mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen eingestuft werden, gelten als Unternehmen mit guter Unternehmensführung.

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet. Nach der Anwendung des Ausschlussverfahrens auf das Universum des Standardindex verringert sich das Indexuniversum um mindestens 20 %.

Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist,

abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Grenzen erlauben dem Fonds, Positionen bis maximal 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds in vom selben Emittenten ausgegebenen einzelnen Indexkomponenten zu halten.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. In diesem Fall kann die Bewertung der Nachhaltigkeitsmerkmale für diese ausgewählten Wertpapiere nicht garantiert werden. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Ab dem Datum dieses Nachtrags berücksichtigen der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf der Fondsebene, um durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachte negative externe Effekte möglichst zu reduzieren.

Dieser Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 SFDR. Weitere Informationen über die ökologischen und sozialen Merkmale sind dem Anhang dieses Nachtrags zu entnehmen.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse

wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Taxonomie-Verordnung: Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Fonds ist nicht verpflichtet, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in taxonomiekonforme Anlagen zu investieren.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Derzeit beteiligt sich der Fonds nicht an einem Wertpapierleihprogramm, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt. **Sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung dieser Politik beschließen, werden die Anteilhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert.**

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Screening-Risiken: Es besteht ein Risiko von Fehlern seitens des Indexanbieters, etwa eine falsche Beurteilung der in der Anlagepolitik beschriebenen Screening-Kriterien und/oder die Aufnahme der falschen/der Ausschluss der richtigen Komponenten im Screening-Prozess. ESG-Scoring und -Screening unterliegen inhärenten methodischen Grenzen. Eine Beurteilung von ESG-Kriterien durch einen Index basiert auf den von Dritten bereitgestellten Daten. Diese Beurteilungen sind von Informationen und Daten abhängig, die unvollständig, unrichtig oder nicht verfügbar sein können, was zu einer falschen Beurteilung der ESG-Performance eines Emittenten führen kann. Insbesondere können Unstimmigkeiten, Ungenauigkeiten oder mangelnde Verfügbarkeit erforderlicher ESG-Daten auftreten, insbesondere, wenn diese von externen Datenlieferanten herausgegeben werden. Diese Grenzen können insbesondere Probleme umfassen im Zusammenhang mit:

- fehlenden oder unvollständigen Daten von Unternehmen (beispielsweise in Bezug auf deren Fähigkeit, ihre Nachhaltigkeitsrisiken zu managen), die als Eingabedaten für ein Scoring-Modell herangezogen wurden;
- die Quantität und die Qualität von zu verarbeitenden ESG-Daten; und
- die Ermittlung relevanter Faktoren für die ESG-Analyse.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Region, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten aus dieser Region betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Region, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken seitens des Index gewährleistet nicht die Minderung eines oder aller Nachhaltigkeitsrisiken. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko: Die Umsetzung des SFDR erfolgt schrittweise ab dem 10. März 2021 und führt neue Offenlegungspflichten für Teilnehmer der Finanzmärkte ein. Zum Datum dieses Prospekts wurden die technischen Regulierungsstandards zur Umsetzung (Stufe 2) für die SFDR von der Europäischen Kommission verabschiedet und gelten ab dem 1. Januar 2023, aber einige von der SFDR eingeführten Konzepte sind derzeit nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Der Fonds wurde in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und

klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Nachtrag und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Informationen und Klassifizierungen gemäß Artikel 8 Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung US-amerikanischer Aktienmärkte suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete hohe Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „Kauf- und Verkaufsinformationen“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P 500 Leaders UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 10 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

SFDR-Anhang

ANHANG II

Vorlage – Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswesen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: State Street SPDR S&P 500 Leaders UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung: 5493003SR7FPZA8MG346

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☒	☐	Ja	☒ ☐	☒	Nein
☐	Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%		☐	Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 0 % an nachhaltigen Investitionen	
☐	☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind		☐	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	
☐	☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind		☐	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	
☐	Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%		☒	☐ mit einem sozialen Ziel	
☒			☒	Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt	

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Faktoren sind diejenigen, die zu den S&P DJI ESG-Scores beitragen. Sie sind eine Funktion einer Bewertung und eines Ratings durch den Anbieter des S&P 500 Scored & Screened Leaders Index (der „Index“) für verschiedene ökologische, soziale und Unternehmensführungsmerkmale von Unternehmen im Indexuniversum.

Weitere Informationen zu den S&P DJI ESG-Scores finden Sie in der Methodik zu den S&P DJI ESG-Scores: <https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-dji-esg-score.pdf> Darüber hinaus schließt der Index Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale aus, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten (in der Indexmethodik beschrieben) berücksichtigt werden.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Der Nachhaltigkeitsindikator, der verwendet wird, um die Erreichung der einzelnen vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, ist das ESG-Rating, das sich aus Daten zusammensetzt, die von den Unternehmen, in die investiert wird, erhoben werden, und die auf einer ESG-Bewertung auf der Grundlage der vom Indexanbieter ermittelten S&P DJI ESG-Scores basieren.

Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht anwendbar

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht anwendbar

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht anwendbar

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

✓ **Ja,**

Der Fonds strebt eine Reduzierung der durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachten negativen externen Effekte an. Er berücksichtigt in diesem Zusammenhang die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Adverse Impacts, „PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er normbasierte ESG-Filter innerhalb des Index anwendet. Der Fonds berücksichtigt insbesondere:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze
- Engagement in umstrittenen Waffen
-

Weitere Informationen zu den PAI finden Sie in den regelmäßigen Fondsberichten.

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung der 500 nach ihrer Marktkapitalisierung größten Unternehmen des US-Aktienmarktes, bekannt als S&P 500 Index (der „Standardindex“), wobei Wertpapiere aufgrund ihrer ESG-Merkmale ausgeschlossen werden, und zwar sowohl im Hinblick auf ihr ESG-Rating als auch auf ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten (in der Indexmethodik beschrieben). Der Index zielt auf 50 % der streubesitzbereinigten Marktkapitalisierung jeder Branchengruppe des Global Industry Classification Standard (GICS) innerhalb des Standardindex ab, wobei ein S&P DJI ESG-Score als definierendes Merkmal verwendet wird. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Faktoren sind diejenigen, die zu den S&P DJI ESG-Scores beitragen, die auf einer Bewertung und einem Rating des Indexanbieters für verschiedene ökologische, soziale und Unternehmensführungsmerkmale für Unternehmen im Indexuniversum beruhen.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index nachzubilden. Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet.

Der Index misst die Wertentwicklung der 500 größten Unternehmen auf dem US-Aktienmarkt nach Marktkapitalisierung des Standardindex. Ökologische und soziale Merkmale werden durch die Verwendung von Filtern beworben, um Wertpapiere auszuschließen, die mit bestimmten Sektoren, Unternehmen oder Praktiken in Verbindung stehen. Sie basieren auf spezifischen ESG-Kriterien und Best-in-Class-ESG-Performance im Vergleich zu Anlageuniversen und/oder im Branchenvergleich, wenn sie anhand objektiver Kriterien innerhalb des Index bewertet werden.

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

Der Fonds schließt Anlagen in Emittenten aus, wie in der Anlagestrategie und den verbindlichen Anforderungen vorstehend dargelegt, sieht jedoch keinen festgelegten Mindestsatz vor, um den Umfang der Anlagen zu reduzieren.

Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?

Unternehmen, die vom Indexanbieter als konform mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen eingestuft werden, gelten als Unternehmen mit guter Unternehmensführung.

Weitere Informationen finden Sie in der Indexmethodik:

<https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-dji-esg-score.pdf>

Die **Anlagestrategie** dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Die Verfahrensweisen einer **guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

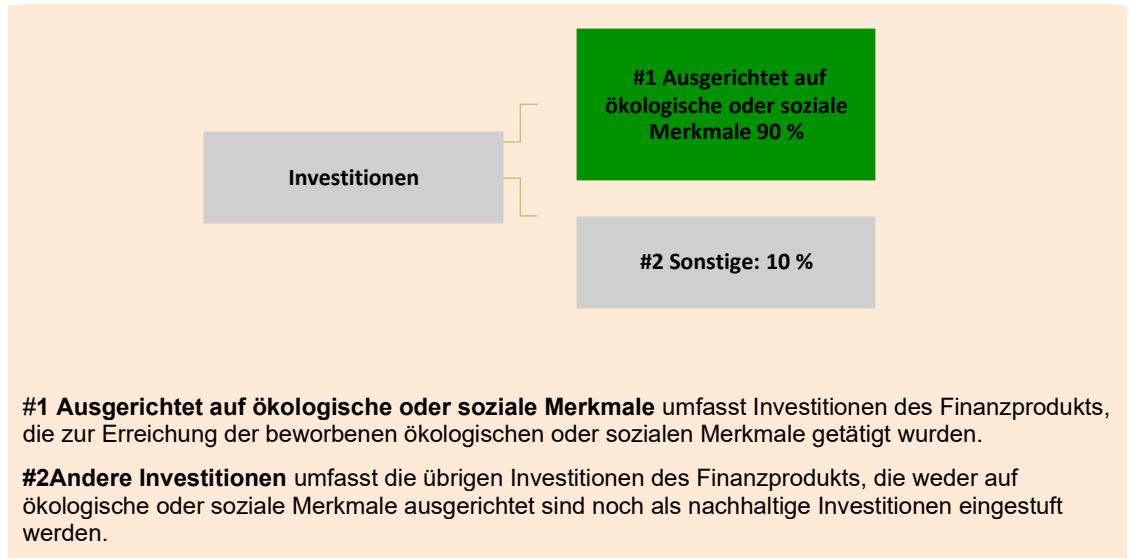
Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index enthalten und auf ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, während der Indexanbieter ESG-Ratings für alle Indexkomponenten anwendet. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen im Sinne der SFDR oder der Taxonomie-Verordnung. Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters 10 % seines Vermögens in Form von Zahlungsmitteln oder Zahlungsmitteläquivalenten und Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden, und die in der nachstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft würden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.



Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Soweit der Fonds zum Zweck der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzt, werden diese nicht zur Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Daher verpflichtet sich der Fonds nicht, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in Anlagen zu investieren, die der Taxonomie-Verordnung entsprechen. Daher ist zu beachten, dass dieser Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Taxonomie-Verordnung nicht berücksichtigt. Es ist daher keine Ausrichtung des Portfolios an der Taxonomie-Verordnung geplant. Aus diesem Grund gilt der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ für keine der Anlagen dieses Fonds und

Es ist keine Ausrichtung an der Taxonomie-Verordnung beabsichtigt.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

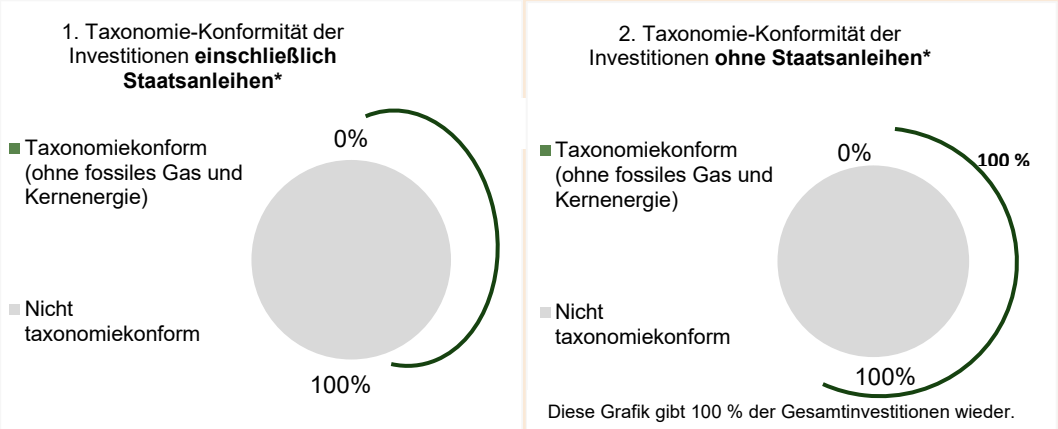
☐ Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

☒ Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu einem Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten.

 Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

 Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht anwendbar.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomie **nicht** berücksichtigen.



Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen Teil seines Vermögens in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten sowie in Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden und die in der vorstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft werden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.



Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Der Fonds bildet die Wertentwicklung des S&P 500 Scored & Screened Leaders Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nach und strebt danach, so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?

Die Indexmethodik sieht eine laufende Überprüfung und jährliche Neugewichtung vor, bei der der Standardindex auf die oben dargelegten ESG-Ausschlusskriterien überprüft wird.

Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?

Der Fonds wird jährlich in Übereinstimmung mit der Häufigkeit der Neugewichtung des Index ebenfalls neu gewichtet.

Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?

Der bestimmte Index implementiert Ausschlüsse und Änderungen der Indexgewichtungen gegenüber dem relevanten breiten Marktindex, die von den ESG-Merkmalen der Unternehmen abhängen, wobei sowohl ESG-Ratings als auch die Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten berücksichtigt werden, wie vom Indexanbieter S&P Dow Jones Indices LLC („SPDJ“) festgelegt. Informationen zur Indexmethodik, die bei der Konstruktion des Index verwendet wird, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von SPDJI.

Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?

<https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-dji-esg-score.pdf>

Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:

Anlagen in SPDR Exchange Traded Funds (ETFs) ([ssga.com](https://www.ssga.com))



DER STATE STREET SPDR S&P 500 LEADERS UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P 500 LEADERS UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P 500 LEADERS UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P 500 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P 500 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET CORPORATION ODER DES STATE STREET SPDR S&P 500 LEADERS UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P 500 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P 500 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DER GESELLSCHAFTER BZW. ANLEGER DES STATE STREET SPDR S&P 500 SCORED & SCREENED LEADERS UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P 500 LEADERS UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P 500 LEADERS UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P 500 LEADERS UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P 500 LEADERS UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P 500 LEADERS UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P 500 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P 500 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN GESELLSCHAFTERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P 500 LEADERS UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P 500 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P 500 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P 500 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (UND INSBESONDERE FÜR ENTGANGENE GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P 500 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Verordnung (EU) 2016/1011 [Benchmark-Verordnung]) die folgende Benchmark:

S&P 500 Scored & Screened Leaders Index

Zum Datum des Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register der Referenzwerte aus Drittstaaten (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als in Einklang mit Artikel 33 der Benchmark-Verordnung anerkannter Administrator eingetragen.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF

Nachtrag Nr. 60

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited und State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel 8-Fonds, vom Index einbezogenes Nachhaltigkeitsrisiko

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 15:00 Uhr. (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index (I35146US).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		MXN abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored MXN Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF		MXN	
Währungsgesicherte r Index	k. A.		Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index (EUR Hedged)		Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index (GBP Hedged)		Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index (CHF Hedged)		Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index (MXN abgesichert)*	
Index Ticker	I35146US		H35146EU		H35146GB		H35146CH		H35146MX	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,15 %		Bis zu 0,20 %							

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds besteht darin, den Anlegern eine Gesamtrendite unter Berücksichtigung von Erträgen und Veräußerungsgewinnen zu bieten, die im Allgemeinen die Rendite des Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index widerspiegelt.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index ist ein Vergleichsmaßstab für auf US-Dollar lautende festverzinsliche Wertpapiere mit Investment Grade, der seinen R-Factor™-Wert optimiert, ein Rating zu den Faktoren Umwelt, Soziales und Governance („ESG“), das von State Street Global Advisors® bereitgestellt wird. Auf der Grundlage des Bloomberg U.S. Corporate Bond Index (der „U.S. Corporate Index“) wählt der Index Wertpapiere aus, die für den U.S. Corporate Index geeignet sind, und zielt dann darauf ab, bestimmte Emittenten auf der Grundlage ihrer ESG-Merkmale auszuschließen. Dabei werden sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten, wie in der Indexmethode beschrieben, berücksichtigt. Anschließend gewichtet der Index die Wertpapiere mithilfe eines Optimierungsprozesses zwecks Maximierung des ESG-Ratings des Portfolios und zur gleichzeitigen Kontrolle des aktiven Gesamtrisikos. Das aktive Gesamtrisiko bezieht sich auf die Abweichung zwischen dem Index und dem U.S. Corporate Index.

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet. Nach Anwendung eines Filters, mit dem mindestens 20 % der Wertpapiere aus dem U.S. Corporate Index mit dem schlechtesten ESG-Rating eliminiert werden, wird das sich daraus ergebende ESG-Rating des Portfolios voraussichtlich höher sein als das ESG-Rating des Portfolios des U.S. Corporate Index.

Die Übernahme dieser Filter und „Best-in-Class“-Kriterien im Index entsprechen den vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Faktoren, wie in den Unterabschnitten „ESG-Screening“ und „Best-in-Class-ESG-Anlagen“ des Abschnitts „ESG-Anlagen“ des Prospekts näher beschrieben. Unternehmen, die nach Einschätzung des Indexanbieters den Prinzipien des United Nations Global Compact entsprechen, gelten als eine gute Unternehmensführung aufweisend. Die wichtigsten methodischen Grenzen werden im Unterabschnitt „Screening-Risiken“ des Abschnitts „Anlagerisiken“ dieses Nachtrags beschrieben.

Die Aufnahme in den Index erfolgt auf Basis der Emissionswährung, nicht auf Basis des Sitzes des Emittenten. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn

Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ im Prospekt näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. In diesem Fall kann die Bewertung der Nachhaltigkeitsmerkmale für diese ausgewählten Wertpapiere nicht garantiert werden. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Ab dem Datum dieses Nachtrags berücksichtigen der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf der Fondsebene, um durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachte negative externe Effekte möglichst zu reduzieren.

Dieser Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 SFDR. Weitere Informationen über die ökologischen und sozialen Merkmale sind dem Anhang dieses Nachtrags zu entnehmen.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Taxonomie-Verordnung. Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Der Grundsatz

„Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Fonds ist nicht verpflichtet, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in taxonomiekonforme Anlagen zu investieren.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, handelt es sich ausschließlich um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen sowie Unternehmensanleihen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Derzeit beteiligt sich der Fonds nicht an einem Wertpapierleihprogramm, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt. Sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung dieser Politik beschließen, werden die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus

sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage

vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditschwierigkeiten unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter dennoch weiter halten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Screening-Risiken: Es besteht ein Risiko von Fehlern seitens des Indexanbieters, etwa eine falsche Beurteilung der in der Anlagepolitik beschriebenen Screening-Kriterien und/oder die Aufnahme der falschen/der Ausschluss der richtigen Komponenten im Screening-Prozess. ESG-Scoring und -Screening unterliegen inhärenten methodischen Grenzen. Eine Beurteilung von ESG-Kriterien durch einen Index basiert auf den von Dritten bereitgestellten Daten. Diese Beurteilungen sind von Informationen und Daten abhängig, die unvollständig, unrichtig oder nicht verfügbar sein können, was zu einer falschen Beurteilung der ESG-Performance eines Emittenten führen kann. Insbesondere können Unstimmigkeiten, Ungenauigkeiten oder mangelnde Verfügbarkeit erforderlicher ESG-Daten auftreten, insbesondere, wenn diese von externen Datenlieferanten herausgegeben werden. Diese Grenzen können insbesondere Probleme umfassen im Zusammenhang mit:

- fehlenden oder unvollständigen Daten von Unternehmen (beispielsweise in Bezug auf deren Fähigkeit, ihre Nachhaltigkeitsrisiken zu managen), die als Eingabedaten für ein Scoring-Modell herangezogen wurden;
- die Quantität und die Qualität von zu verarbeitenden ESG-Daten; und
- die Ermittlung relevanter Faktoren für die ESG-Analyse.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch

die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken seitens des Index gewährleistet nicht die Minderung eines oder aller Nachhaltigkeitsrisiken. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko: Die Umsetzung des SFDR erfolgt schrittweise ab dem 10. März 2021 und führt neue Offenlegungspflichten für Teilnehmer der Finanzmärkte ein. Zum Datum dieses Prospekts wurden die technischen Regulierungsstandards zur Umsetzung (Stufe 2) für die SFDR von der Europäischen Kommission verabschiedet und gelten ab dem 1. Januar 2023, aber einige von der SFDR eingeführten Konzepte sind derzeit nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Der Fonds wurde in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Nachtrag und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Informationen und Klassifizierungen gemäß Artikel 8 Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für auf US-Dollar lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds, in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF (Acc)

State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF

State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored EUR
Hdg UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder von den Unteranlageverwaltern festgelegten und dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilten Beträgen entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

SFDR-Anhang

ANHANG II

Vorlage – Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung: 549300D905F5P2DTYB19

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☒	☐	Ja	☒ ☐	☒	Nein
☐	Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%		☐	Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 0 % an nachhaltigen Investitionen	
☐	☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind		☐	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	
☐	☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind		☐	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	
☐	☐ Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%		☒	☐ mit einem sozialen Ziel	
☐	☒ Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt				

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Faktoren sind diejenigen, die zu den R-Factor™-Scores beitragen, die auf Indexkomponenten einschließlich des Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index (der „Index“) angewandt werden. Sie basieren auf einer Bewertung und einem Rating des Indexanbieters für verschiedene ökologische, soziale und Unternehmensführungsmerkmale der Unternehmen im Indexuniversum.

Weitere Informationen über R-Factor™-Scores finden Sie auf der SSGA-Website:

https://www.ssga.com/uk/en_gb/intermediary/ic/capabilities/esg/data-scoring/r-factor-transparent-esg-scoring#:~:text=R%2DFactor%E2%84%A2%20is%20the,materiality%20in%20the%20scoring%20process.

Des Weiteren schließt der Index Emittenten aus, die mit extrem umstrittenen Ereignissen, kontroversen Waffen, Verstößen gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC“), zivilen Schusswaffen, der Förderung von Kraftwerkskohle und Tabakunternehmen in Verbindung gebracht werden.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Die Nachhaltigkeitsindikatoren, mit denen die Erreichung der einzelnen von diesem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale gemessen wird, basieren auf dem Index, der ein ESG-Rating optimiert, das sich aus einem Verantwortungsfaktor („Responsibility Factor“, „R-Factor™“) zusammensetzt. Der R-Faktor™ geht bei der ESG-Bewertung so vor, dass er das gesamte Spektrum der „finanziell wesentlichen“ Messgrößen erfasst, um die langfristigen Nachhaltigkeitstreiber für den Wert in den Bereichen Umwelt, Humankapital, Sozialkapital, Geschäftsmodell, Management und Unternehmensführung zu isolieren.

Die Bewertungsmethode bezieht systematisch Best-in-Class-Daten, einen transparenten Nachhaltigkeitsrahmen und branchenübergreifende finanzielle Wesentlichkeit ein, um einen R-Factor™-Score für jedes Unternehmen zu bestimmen.

Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht anwendbar

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht anwendbar

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht anwendbar

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?



Ja,

Der Fonds strebt eine Reduzierung der durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachten negativen externen Effekte an. Er berücksichtigt in diesem Zusammenhang die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Adverse Impacts, „PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er normbasierte ESG-Filter innerhalb des Index anwendet. Der Fonds berücksichtigt insbesondere:



- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze
 - Engagement in umstrittenen Waffen
- Weitere Informationen zu den PAI finden Sie in den regelmäßigen Fondsberichten.

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der Index-Wertentwicklung zu minimieren.

Der Index ist eine Benchmark für auf US-Dollar lautende, festverzinsliche Wertpapiere mit Investment Grade (hohe Qualität), die ihren R-Factor™-Score, ein von State Street Global Advisors® bereitgestelltes Rating für ökologische, soziale und Unternehmensführungsmerkmale („ESG“), optimiert. Auf der Grundlage des Bloomberg U.S. Corporate Bond Index (der „U.S. Corporate Index“) wählt der Index Wertpapiere aus, die für den U.S. Corporate Index in Frage kommen. Im Anschluss zielt er dann darauf ab, bestimmte Emittenten aufgrund ihrer ESG-Merkmale auszuschließen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten (beschrieben in der Indexmethodik) berücksichtigt werden.

Anschließend gewichtet der Index die Wertpapiere mithilfe eines Optimierungsprozesses zwecks Maximierung des ESG-Ratings des Portfolios und zur gleichzeitigen Kontrolle des aktiven Gesamtrisikos. Das aktive Gesamtrisiko bezieht sich auf die Abweichung zwischen dem Index und dem U.S. Corporate Index.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investiert im Namen des Fonds unter Anwendung der im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ des Prospekts näher beschriebenen Strategie stratifizierter Stichproben in erster Linie in die Wertpapiere des Index, und zwar jederzeit in Übereinstimmung mit den im Prospekt dargelegten Anlagebeschränkungen.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index nachzubilden. Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet.

Ökologische und soziale Merkmale werden durch die Verwendung von Filtern beworben, um Wertpapiere auszuschließen, die mit bestimmten Sektoren, Unternehmen oder Praktiken in Verbindung stehen. Sie basieren auf spezifischen ESG-Kriterien und Best-in-Class-ESG-Performance im Vergleich zu Anlageuniversen und/oder im Branchenvergleich, wenn sie anhand objektiver Kriterien innerhalb des Index bewertet werden.

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

Der Fonds schließt Anlagen in Emittenten aus, wie in der Anlagestrategie und den verbindlichen Anforderungen vorstehend dargelegt, sieht jedoch keinen festgelegten Mindestsatz vor, um den Umfang der Anlagen zu reduzieren.

Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?

Unternehmen, die nach Ansicht des Indexanbieters nicht gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen, gelten als Unternehmen mit einer guten Unternehmensführung. Informationen zu den Methoden, die bei der Konstruktion des Index verwendet werden, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von Bloomberg, die unter folgendem Link abrufbar ist:

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index enthalten und auf ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, während der Indexanbieter ESG-Ratings für alle Indexkomponenten anwendet. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen im Sinne der SFDR oder der Taxonomie-Verordnung. Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters 10 % seines Vermögens in Form von Zahlungsmitteln oder Zahlungsmitteläquivalenten und Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden, und die in der nachstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft würden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.

Die **Anlagestrategie** dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Die Verfahrensweisen einer **guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.



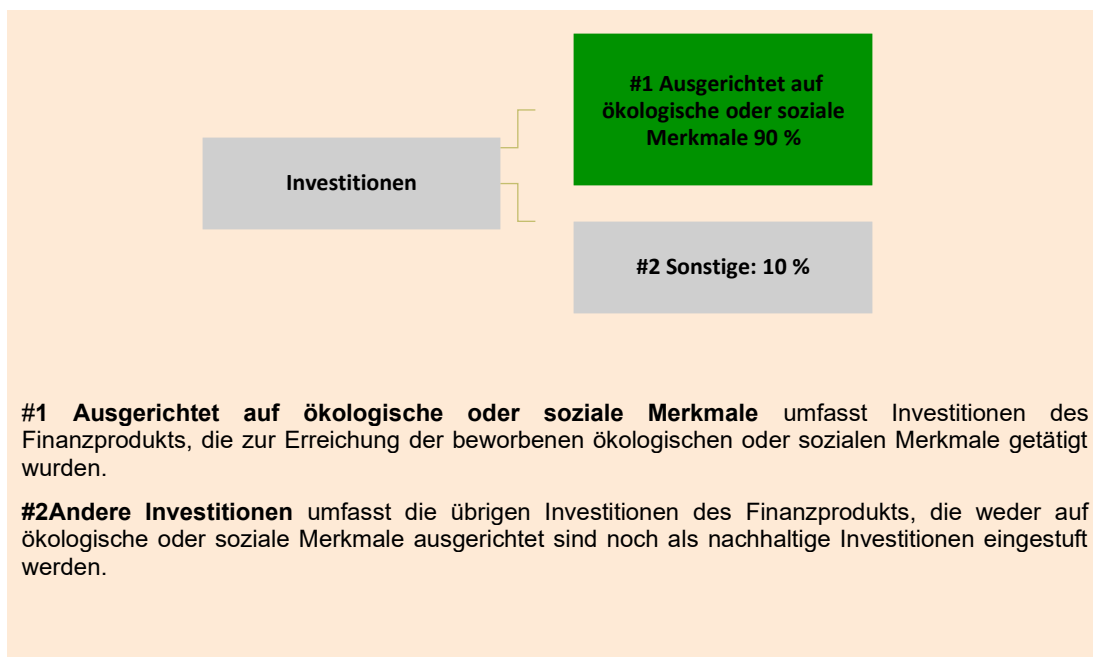
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Soweit der Fonds ausschließlich zum Zweck der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzt, werden diese nicht zur Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Daher verpflichtet sich der Fonds nicht, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in Anlagen zu investieren, die der Taxonomie-Verordnung entsprechen. Daher ist zu beachten, dass dieser Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Taxonomie-Verordnung nicht berücksichtigt. Es ist daher keine Ausrichtung des Portfolios an der Taxonomie-Verordnung geplant. Aus diesem Grund gilt der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ für keine der Anlagen dieses Fonds und

Es ist keine Ausrichtung an der Taxonomie-Verordnung beabsichtigt.

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

Ja:

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

☐ In fossiles Gas
 ☐ In Kernenergie
☒ **Nein**

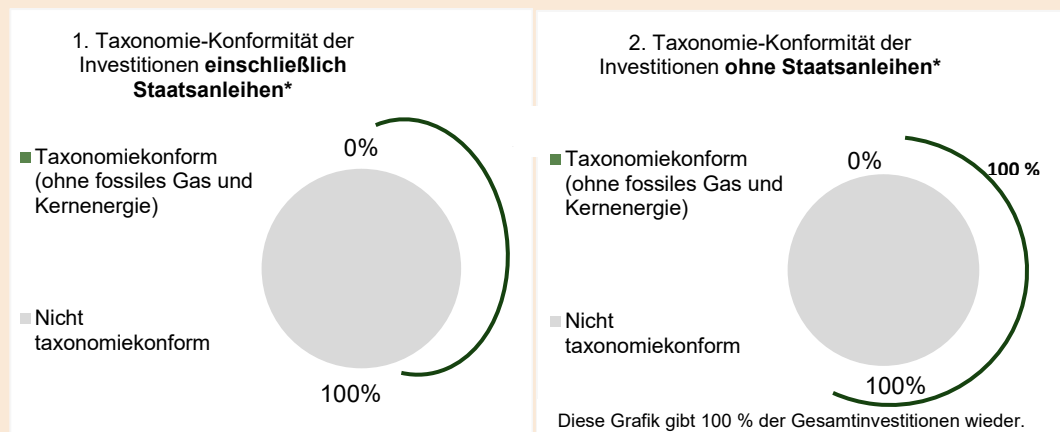
Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



*** Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.**

Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Der Fonds verpflichtet sich zu einem Mindestanteil an Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten.



Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht anwendbar.



Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen Teil seines Vermögens in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten sowie in Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden und die in der vorstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft werden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Der Fonds bildet die Wertentwicklung des Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so weit wie möglich nach und strebt danach so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren. Der Index ist eine Benchmark für auf Euro lautende, festverzinsliche Wertpapiere mit Investment Grade, die ihren R-Factor™-Score, ein von State Street Global Advisors® bereitgestelltes Rating (wie oben beschrieben), optimiert.

Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?

Die Indexmethodik sieht eine monatliche Überprüfung und Neugewichtung vor.

Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?

Der Fonds wird monatlich in Übereinstimmung mit der Häufigkeit der Neugewichtung des Index ebenfalls neu gewichtet.

Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?

Der bestimmte Index implementiert Ausschlüsse und Änderungen der Indexgewichtungen gegenüber dem relevanten breiten Marktindex, die von den ESG-Merkmalen der Unternehmen abhängen, wobei sowohl ESG-Ratings als auch die Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten berücksichtigt werden, wie vom Indexanbieter Bloomberg festgelegt. Informationen zur Indexmethodik, die bei der Konstruktion des Index verwendet wird, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von Bloomberg.

Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:

[Anlagen in SPDR Exchange Traded Funds \(ETFs\) \(ssga.com\)](https://www.ssga.com)



BLOOMBERG® und Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg U.S. Corporate Scored UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG BLOOMBERG SASB SCORED U.S. CORPORATE EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. CORPORATE SCORED UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG SASB U.S. CORPORATE ESG EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG SASB SCORED U.S. CORPORATE EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR

DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG U.S. CORPORATE SCORED UCITS ETF ODER DEM BLOOMBERG SASB SCORED U.S. CORPORATE EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index verwenden.

SASB® vertritt in Bezug darauf, ob ein Emittent in den Bloomberg SASB Scored U.S. Corporate Ex-Controversies Select Index aufgenommen oder von diesem ausgeschlossen werden sollte, keinen Standpunkt.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF

Nachtrag Nr. 61

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	EUR
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Für französische Aktienpläne (PEA) geeignet	Ja
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März und September), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel 8-Fonds, vom Index einbezogenes Nachhaltigkeitsrisiko

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 14.30 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Zeichnungen und Rücknahmen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P Euro High Yield Dividend Aristocrats Screened Index (SPEHDAEN)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/dividends-factors/sp-euro-high-yield-dividend-aristocrats-screened-index/#overview/ https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	18:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	EUR nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	EUR	
Index Ticker	SPEHDAEN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,30 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Teilfonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von bestimmten dividendenstarken Aktienwerten, die von Unternehmen in der Eurozone emittiert werden.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung von dividendenstarken Aktien aus der Eurozone, welche die im S&P Euro High Yield Dividend Aristocrats Index (der „Standardindex“) definierten Zulassungskriterien erfüllen. Ferner ist der Index darauf ausgerichtet, bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale auszuschließen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen geschäftlichen Tätigkeiten berücksichtigt wird, wie in der Indexmethodik angegeben. Im Anschluss werden die verbleibenden Wertpapiere nach der Höhe ihrer Dividenden gewichtet.

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet. Der Index schließt im Vergleich zum Universum des Standardindex mindestens 20 % der Wertpapiere mit dem niedrigsten Rating aus. Daher ist davon auszugehen, dass das resultierende ESG-Rating des Fonds höher ausfällt als das ESG-Rating eines Fonds, der den Standardindex nachbildet.

Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Die Übernahme von Filtern im Index entspricht den vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Faktoren, wie im Unterabschnitt „**ESG-Screening**“ des Abschnitts „**ESG-Anlagen**“ des Prospekts näher beschrieben. Unternehmen, die nach Einschätzung des Indexanbieters in Bezug auf die Prinzipien des UN Global Compact keine ausgesprochen schlechten Leistungen bringen, gelten als eine gute Unternehmensführung aufweisend. Die wichtigsten methodischen Grenzen werden im Unterabschnitt „**Screening-Risiken**“ des Abschnitts „**Anlagerisiken**“ dieses Nachtrags beschrieben.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Limits erlauben es dem Fonds, Positionen in einzelnen Komponenten des Index, die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter

außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. In diesem Fall kann die Bewertung der Nachhaltigkeitsmerkmale für diese ausgewählten Wertpapiere nicht garantiert werden. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Ab dem Datum dieses Nachtrags berücksichtigen der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf der Fondsebene, um durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachte negative externe Effekte möglichst zu reduzieren.

Dieser Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 SFDR. Weitere Informationen über die ökologischen und sozialen Merkmale sind dem Anhang dieses Nachtrags zu entnehmen.

Taxonomie-Verordnung. Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Fonds ist nicht verpflichtet, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in taxonomiekonforme Anlagen zu investieren.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („**DFI**“). Der Einsatz von DFI durch den Fonds beschränkt sich auf Futures. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt

„Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Derzeit beteiligt sich der Fonds nicht an einem Wertpapierleihprogramm, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt. Sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung dieser Politik beschließen, werden die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Untanlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquiden Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder eine geringe Zahl von Aktien oder eine Region, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung oder dieser Aktien oder aus dieser Region betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung oder eine geringe Zahl von Aktien oder eine Region, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz

von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Screening-Risiken: Es besteht ein Risiko von Fehlern seitens des Indexanbieters, etwa eine falsche Beurteilung der in der Anlagepolitik beschriebenen Screening-Kriterien und/oder die Aufnahme der falschen/der Ausschluss der richtigen Komponenten im Screening-Prozess. ESG-Scoring und -Screening unterliegen inhärenten methodischen Grenzen. Eine Beurteilung von ESG-Kriterien durch einen Index basiert auf den von Dritten bereitgestellten Daten. Diese Beurteilungen sind von Informationen und Daten abhängig, die unvollständig, unrichtig oder nicht verfügbar sein können, was zu einer falschen Beurteilung der ESG-Performance eines Emittenten führen kann. Insbesondere können Unstimmigkeiten, Ungenauigkeiten oder mangelnde Verfügbarkeit erforderlicher ESG-Daten auftreten, insbesondere, wenn diese von externen Datenlieferanten herausgegeben werden. Diese Grenzen können insbesondere Probleme umfassen im Zusammenhang mit:

- fehlenden oder unvollständigen Daten von Unternehmen (beispielsweise in Bezug auf deren Fähigkeit, ihre Nachhaltigkeitsrisiken zu managen), die als Eingabedaten für ein Scoring-Modell herangezogen wurden;
- die Quantität und die Qualität von zu verarbeitenden ESG-Daten; und
- die Ermittlung relevanter Faktoren für die ESG-Analyse.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken seitens des Index gewährleistet nicht die Minderung eines oder aller Nachhaltigkeitsrisiken. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko: Die Umsetzung des SFDR erfolgt schrittweise ab dem 10. März 2021 und führt neue Offenlegungspflichten für Teilnehmer der Finanzmärkte ein. Zum Datum dieses Prospekts wurden die technischen Regulierungsstandards zur Umsetzung (Stufe 2) für die SFDR von der Europäischen Kommission verabschiedet und gelten ab dem 1. Januar 2023, aber einige von der SFDR eingeführten Konzepte sind derzeit nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Der Fonds wurde in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Nachtrag und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Informationen und Klassifizierungen gemäß Artikel 8 Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung von dividendenstarken Aktien aus der Eurozone suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der **„Erstausgabezeitraum“**). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

SFDR-Anhang

ANHANG II

Vorlage – Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswesen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung: 549300T41OSJYVV1LD06

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☐ ☐ Ja	☒ ☐ ☒ Nein
☐ Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%	☐ Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 0 % an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ mit einem sozialen Ziel
	☒ Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Der State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF ist ein Indexfonds, der die Wertentwicklung des S&P Euro Screened High Yield Dividend Aristocrats Index (der „Index“) nachbildet. Der Index wurde zu dem Zweck bestimmt, die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen. Der Index repräsentiert die Wertentwicklung gewisser dividendenstarker Aktien von Unternehmen aus der Eurozone, wobei bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale ausgeschlossen werden, und zwar sowohl im Hinblick auf ihr ESG-Rating als auch auf ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten (in der Indexmethodik beschrieben).



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Der Index repräsentiert die Wertentwicklung gewisser dividendenstarker Aktienwerte von Unternehmen aus der Eurozone, wobei bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale ausgeschlossen werden, und zwar sowohl im Hinblick auf ihr ESG-Rating als auch auf ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten. Folglich wird die Erreichung der damit verbundenen ökologischen und sozialen Merkmale durch den Ausschluss von Unternehmen aus dem Index gemessen, die mit kontroversen Waffen, Kraftwerkskohle, Tabakprodukten, Ölsanden, Kleinwaffen und militärischen Aufträgen in Verbindung gebracht werden, sowie von Unternehmen, die die UNGC-Grundsätze nicht einhalten.

Daher beabsichtigt der Fonds nicht, Wertpapiere zu halten, die die oben genannten maßgeblichen ESG-Kriterien nicht erfüllen.

Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht anwendbar

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht anwendbar

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht anwendbar

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?



Ja,

Der Fonds strebt eine Reduzierung der durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachten negativen externen Effekte an. Er berücksichtigt in diesem Zusammenhang die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Adverse Impacts, „PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er normbasierte ESG-Filter innerhalb des Index anwendet. Der Fonds berücksichtigt insbesondere:



- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze
- Engagement in umstrittenen Waffen

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung von dividendenstarken Aktien aus der Eurozone, welche die im S&P Euro High Yield Dividend Aristocrats Index (der „Standardindex“) definierten Zulassungskriterien erfüllen. Ferner ist der Index darauf ausgerichtet, bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale auszuschließen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen geschäftlichen Tätigkeiten berücksichtigt wird, wie in der Indexmethodik angegeben. Im Anschluss werden die verbleibenden Wertpapiere nach der Höhe ihrer Dividenden gewichtet.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index nachzubilden. Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet.

Ökologische und soziale Merkmale werden durch die Verwendung von Filtern gefördert, um Wertpapiere auszuschließen, die basierend auf spezifischen ESG-Kriterien mit bestimmten Sektoren, Unternehmen oder Praktiken verbunden sind.

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

Der Fonds schließt Anlagen in Emittenten aus, wie in der Anlagestrategie und den verbindlichen Anforderungen vorstehend dargelegt, sieht jedoch keinen festgelegten Mindestsatz vor, um den Umfang der Anlagen zu reduzieren.

Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?

Unternehmen, die nach Ansicht des Indexanbieters nicht gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen, gelten als Unternehmen mit einer guten Unternehmensführung. Informationen zu den Methoden, die bei der Konstruktion des Index verwendet werden, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von S&P, die unter folgendem Link abrufbar ist:

<https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-esg-divarist-indices.pdf>

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index enthalten und auf ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, während der Indexanbieter ESG-Ratings für alle Indexkomponenten anwendet. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen im Sinne der SFDR oder der Taxonomie-Verordnung. Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters 10 % seines Vermögens in Form von Zahlungsmitteln oder Zahlungsmitteläquivalenten und Derivaten halten, die für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden und die in der nachstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft würden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.

Die **Anlagestrategie** dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Die Verfahrensweisen einer **guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.



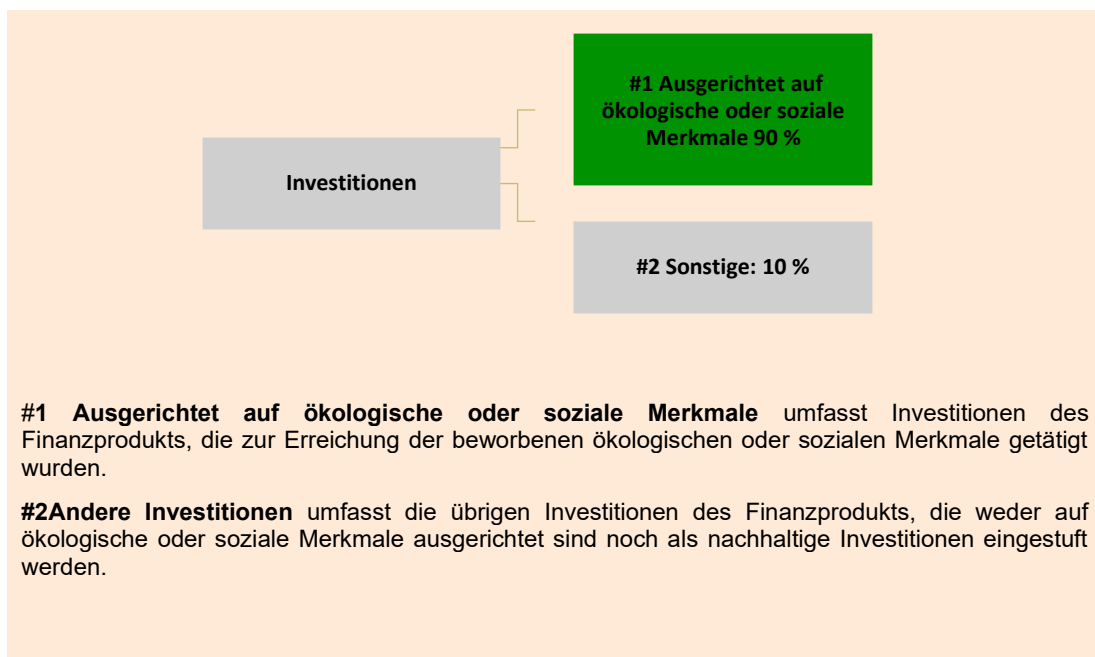
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Soweit der Fonds ausschließlich zum Zweck des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzt, werden diese nicht zur Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Daher verpflichtet sich der Fonds nicht, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in Anlagen zu investieren, die der Taxonomie-Verordnung entsprechen. Daher ist zu beachten, dass dieser Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Taxonomie-Verordnung nicht berücksichtigt. Es ist daher keine Ausrichtung des Portfolios an der Taxonomie-Verordnung geplant. Aus diesem Grund gilt der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ für keine der Anlagen dieses Fonds und

Es ist keine Ausrichtung an der Taxonomie-Verordnung beabsichtigt.

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐

Ja:

☐

In fossiles Gas

☐

In Kernenergie



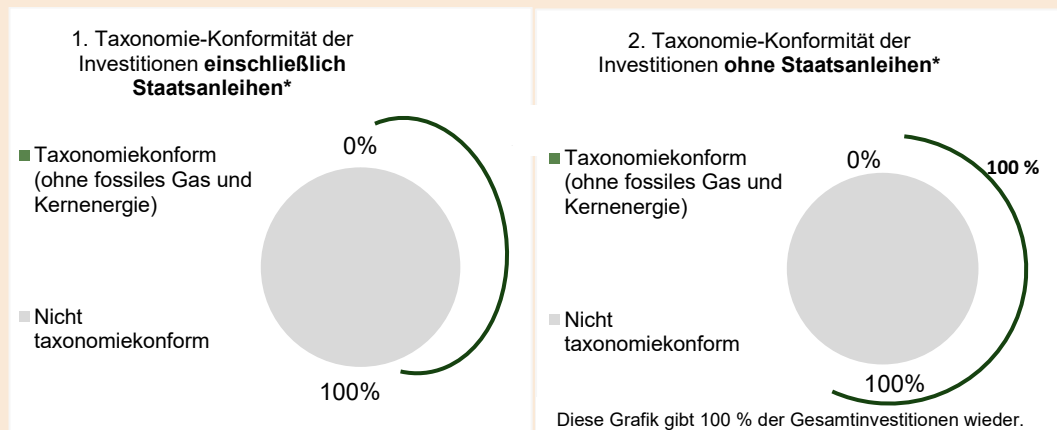
Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Der Fonds verpflichtet sich zu einem Mindestanteil an Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.



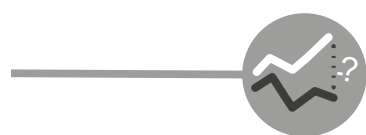
Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht anwendbar.



Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen Teil seines Vermögens in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten sowie Derivaten halten, die nach dem Ermessen des Anlageverwalters zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden und die in der vorstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft werden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.



Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Der Fonds bildet die Wertentwicklung des S&P Euro High Yield Dividend Aristocrats Screened Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

möglich nach und strebt danach, so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung von dividendenstarken Aktien aus der Eurozone, welche die im S&P Euro High Yield Dividend Aristocrats Index (der „Standardindex“) definierten Zulassungskriterien erfüllen. Ferner ist der Index darauf ausgerichtet, bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale auszuschließen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen geschäftlichen Tätigkeiten berücksichtigt wird, wie in der Indexmethodik angegeben.

Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?

Die Indexmethodik sieht eine vierteljährliche Überprüfung und Neugewichtung vor.

Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?

Der Fonds wird vierteljährlich in Übereinstimmung mit der Häufigkeit der Neugewichtung des Index ebenfalls neu gewichtet.

Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?

Der bestimmte Index implementiert Ausschlüsse und Änderungen der Indexgewichtungen gegenüber dem relevanten breiten Marktindex, die von den ESG-Merkmalen der Unternehmen abhängen, wobei sowohl ESG-Ratings als auch die Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten berücksichtigt werden, wie vom Indexanbieter S&P Dow Jones Indices LLC („SPDJ“) festgelegt. Informationen zur Indexmethodik, die bei der Konstruktion des Index verwendet wird, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von SPDJI.

Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?

Die Beschreibung der Indexmethodik von S&P finden Sie unter dem folgenden Link: <https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-esg-divarist-indices.pdf>.

Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:

[Anlagen in SPDR Exchange Traded Funds \(ETFs\) \(ssga.com\)](https://www.ssga.com)



DER STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET CORPORATION ODER DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND SCREENED ARISTOCRATS INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P EURO DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN HAFTET

S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (U. A. EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P EURO HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P Euro High Yield Dividend Aristocrats Screened Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als Administrator gemäß Artikel 33 der Benchmark-Verordnung eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc
19. Februar 2026

State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF

Nachtrag Nr. 62

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar, April, Juli und Oktober), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel 8-Fonds, vom Index einbezogenes Nachhaltigkeitsrisiko

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	Für Zeichnungen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag, für Rücknahmen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P Global Dividend Aristocrats Screened Quality Income Index (SPGEDAUN)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Halbjährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/dividends-factors/sp-global-dividend-aristocrats-quality-income-screened-index/#overview/ https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilstklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD	
Index Ticker	SPGEDAUN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „ Gebühren und Kosten “ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,45 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung weltweiter Aktien mit hoher Dividendenrendite.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus Industrie- und Schwellenländern weltweit, welche die im S&P Global Dividend Aristocrats Quality Income Index (der „Standardindex“) festgelegten Eignungskriterien erfüllen. Ferner ist der Index darauf ausgerichtet, bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale auszuschließen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen geschäftlichen Tätigkeiten berücksichtigt wird, wie in der Indexmethodik angegeben. Im Anschluss werden die verbleibenden Wertpapiere nach der Höhe ihrer Dividenden gewichtet.

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet. Der Index schließt im Vergleich zum Universum des Standardindex mindestens 20 % der Wertpapiere mit dem niedrigsten Rating aus. Daher ist davon auszugehen, dass das resultierende ESG-Rating des Fonds höher ausfällt als das ESG-Rating eines Fonds, der den Standardindex nachbildet.

Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Die Übernahme dieser Filter im Index entspricht den vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Faktoren, wie im Unterabschnitt „**ESG-Screening**“ des Abschnitts „**ESG-Anlagen**“ des Prospekts näher beschrieben. Unternehmen, die nach Einschätzung des Indexanbieters in Bezug auf die Prinzipien des UN Global Compact keine ausgesprochen schlechten Leistungen bringen, gelten als eine gute Unternehmensführung aufweisend. Die wichtigsten methodischen Grenzen werden im Unterabschnitt „**Screening-Risiken**“ des Abschnitts „**Anlagerisiken**“ dieses Nachtrags beschrieben.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Grenzen erlauben dem

Fonds, Positionen bis maximal 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds in vom selben Emittenten ausgegebenen einzelnen Indexkomponenten zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. In diesem Fall kann die Bewertung der Nachhaltigkeitsmerkmale für diese ausgewählten Wertpapiere nicht garantiert werden. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Ab dem Datum dieses Nachtrags berücksichtigen der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf der Fondsebene, um durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachte negative externe Effekte möglichst zu reduzieren.

Dieser Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 SFDR. Weitere Informationen über die ökologischen und sozialen Merkmale sind dem Anhang dieses Nachtrags zu entnehmen.

Taxonomie-Verordnung. Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Fonds ist nicht verpflichtet, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in taxonomiekonforme Anlagen zu investieren.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene

Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI durch den Fonds beschränkt sich auf Futures). Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Derzeit beteiligt sich der Fonds nicht an einem Wertpapierleihprogramm, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt. Sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung dieser Politik beschließen, werden die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die

Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine geringe Zahl von Aktien, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die diese geringe Zahl von Aktien betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die die geringe Zahl von Aktien, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Screening-Risiken: Es besteht ein Risiko von Fehlern seitens des Indexanbieters, etwa eine falsche Beurteilung der in der Anlagepolitik beschriebenen Screening-Kriterien und/oder die Aufnahme der falschen/der Ausschluss der richtigen Komponenten im Screening-Prozess. ESG-Scoring und -Screening unterliegen inhärenten methodischen Grenzen. Eine Beurteilung von ESG-Kriterien durch einen Index basiert auf den von Dritten bereitgestellten Daten. Diese Beurteilungen sind von Informationen und Daten abhängig, die unvollständig, unrichtig oder nicht verfügbar sein können, was zu einer falschen Beurteilung der ESG-Performance eines Emittenten führen kann. Insbesondere können Unstimmigkeiten, Ungenauigkeiten oder mangelnde Verfügbarkeit erforderlicher ESG-Daten auftreten, insbesondere, wenn diese von externen Datenlieferanten herausgegeben werden. Diese Grenzen können insbesondere Probleme umfassen im Zusammenhang mit:

- fehlenden oder unvollständigen Daten von Unternehmen (beispielsweise in Bezug auf deren Fähigkeit, ihre Nachhaltigkeitsrisiken zu managen), die als Eingabedaten für ein Scoring-Modell herangezogen wurden;
- die Quantität und die Qualität von zu verarbeitenden ESG-Daten; und
- die Ermittlung relevanter Faktoren für die ESG-Analyse.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken seitens des Index gewährleistet nicht die Minderung eines oder aller Nachhaltigkeitsrisiken. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko: Die Umsetzung des SFDR erfolgt schrittweise ab dem 10. März 2021 und führt neue Offenlegungspflichten für Teilnehmer der Finanzmärkte ein. Zum Datum dieses Prospekts wurden die technischen Regulierungsstandards zur Umsetzung (Stufe 2) für die SFDR von der Europäischen Kommission verabschiedet und gelten ab dem 1. Januar 2023, aber einige von der SFDR eingeführten Konzepte sind derzeit nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Der Fonds wurde in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Nachtrag und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Informationen und Klassifizierungen gemäß Artikel 8 Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus Industrie- und Schwellenländern in aller Welt suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „**Erstausgabezeitraum**“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

SFDR-Anhang

ANHANG II

Vorlage – Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung: 549300XU0OUMJ30E016

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?



Ja



Nein



Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ____%



Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 0 % an nachhaltigen Investitionen

☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ mit einem sozialen Ziel



Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ____%



Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Der State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF ist ein Indexfonds, der die Wertentwicklung des S&P Global Dividend Aristocrats Screened Quality Income Index (der „Index“) nachbildet. Der Index wurde zu dem Zweck bestimmt, die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen. Der Index repräsentiert die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus Industrie- und Schwellenländern weltweit, wobei bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale ausgeschlossen werden, und zwar sowohl im Hinblick auf ihr ESG-Rating als auch auf ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten (in der Indexmethodik beschrieben).



Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Der Index repräsentiert die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus Industrie- und Schwellenländern weltweit, wobei bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale ausgeschlossen werden, und zwar sowohl im Hinblick auf ihr ESG-Rating als auch auf ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten. Folglich wird die Erreichung der damit verbundenen ökologischen und sozialen Merkmale durch den Ausschluss von Unternehmen aus dem Index gemessen, die mit kontroversen Waffen, Kraftwerkskohle, Tabakprodukten, Ölsanden, Kleinwaffen und militärischen Aufträgen in Verbindung gebracht werden, sowie von Unternehmen, die die UNGC-Grundsätze nicht einhalten.

Daher beabsichtigt der Fonds nicht, Wertpapiere zu halten, die die oben genannten maßgeblichen ESG-Kriterien nicht erfüllen.

Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht anwendbar

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht anwendbar

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht anwendbar

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

✓ Ja,

Der Fonds strebt eine Reduzierung der durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachten negativen externen Effekte an. Er berücksichtigt in diesem Zusammenhang die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Adverse Impacts, „PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er normbasierte ESG-Filter innerhalb des Index anwendet. Der Fonds berücksichtigt insbesondere:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze
- Engagement in umstrittenen Waffen

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus Industrie- und Schwellenländern weltweit, welche die im S&P Global Dividend Aristocrats Quality Income Index (der „Standardindex“) festgelegten Eignungskriterien erfüllen. Ferner ist der Index darauf ausgerichtet, bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale auszuschließen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen geschäftlichen Tätigkeiten berücksichtigt wird, wie in der Indexmethodik angegeben. Im Anschluss werden die verbleibenden Wertpapiere nach der Höhe ihrer Dividenden gewichtet.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index nachzubilden. Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet.

Ökologische und soziale Merkmale werden durch die Verwendung von Filtern gefördert, um Wertpapiere auszuschließen, die basierend auf spezifischen ESG-Kriterien mit bestimmten Sektoren, Unternehmen oder Praktiken verbunden sind.

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

Der Fonds schließt Anlagen in Emittenten aus, wie in der Anlagestrategie und den verbindlichen

Anforderungen vorstehend dargelegt, sieht jedoch keinen festgelegten Mindestsatz vor, um

den Umfang der Anlagen zu reduzieren.

Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?

Unternehmen, die nach Ansicht des Indexanbieters nicht gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen, gelten als Unternehmen mit einer guten Unternehmensführung. Informationen zu den Methoden, die bei der Konstruktion des Index verwendet werden, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von S&P, die unter folgendem Link abrufbar ist:

<https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-esg-divarist-indices.pdf>

Die **Anlagestrategie** dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Die Verfahrensweisen einer **guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mit-

arbeiten sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

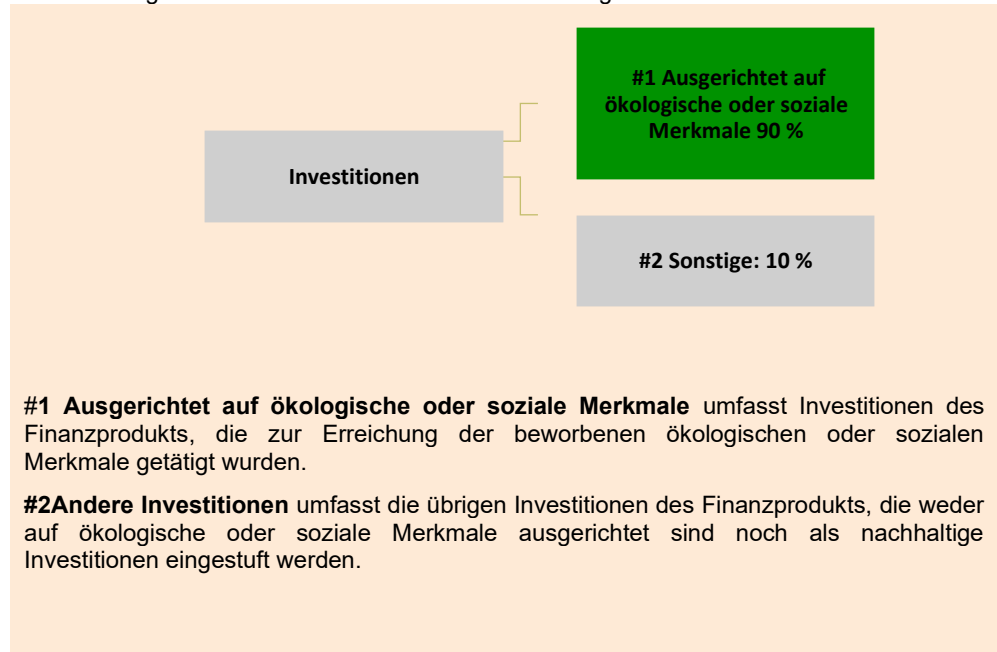
Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index enthalten und auf ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, während der Indexanbieter ESG-Ratings für alle Indexkomponenten anwendet. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen im Sinne der SFDR oder der Taxonomie-Verordnung. Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters 10 % seines Vermögens in Form von Zahlungsmitteln oder Zahlungsmitteläquivalenten und Derivaten halten, die für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden und die in der nachstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft würden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.



Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Soweit der Fonds ausschließlich zum Zweck des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzt, werden diese nicht zur Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Daher verpflichtet sich der Fonds nicht, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in Anlagen zu investieren, die der Taxonomie-Verordnung entsprechen. Daher ist zu beachten, dass dieser Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Taxonomie-Verordnung nicht berücksichtigt. Es ist daher keine Ausrichtung des Portfolios an der Taxonomie-Verordnung geplant. Aus diesem Grund gilt der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ für keine der Anlagen dieses Fonds und

Es ist keine Ausrichtung an der Taxonomie-Verordnung beabsichtigt.

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles

Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

- ☐ **Ja:**
- ☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
- ☒ **Nein**

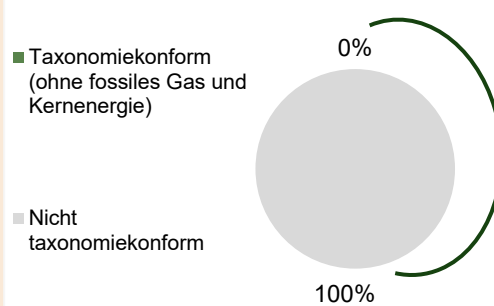
Ermöglichende

Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

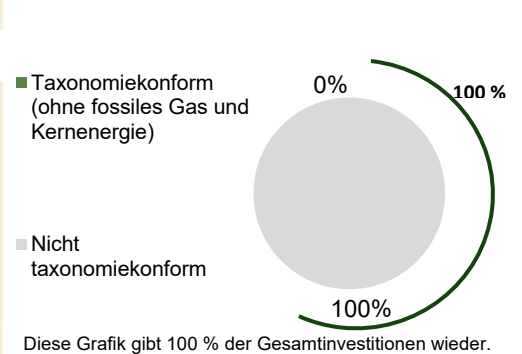
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*

1. Taxonomie-Konformität der Investitionen **einschließlich Staatsanleihen***



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen **ohne Staatsanleihen***



*** Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.**

Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu einem Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten.

Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht anwendbar.

Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen Teil seines Vermögens in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten sowie Derivaten halten, die nach dem Ermessen des Anlageverwalters zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden und die in der vorstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft werden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.



Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Der Fonds bildet die Wertentwicklung des S&P Global Dividend Aristocrats Quality Income Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nach und strebt danach, so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus Industrie- und Schwellenländern weltweit, welche die im S&P Global Dividend Aristocrats Quality Income Index (der „Standardindex“) festgelegten Eignungskriterien erfüllen. Ferner ist der Index darauf ausgerichtet, bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale auszuschließen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen geschäftlichen Tätigkeiten berücksichtigt wird, wie in der Indexmethodik angegeben.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?

Die Indexmethodik sieht eine halbjährliche Überprüfung und Neugewichtung vor.

Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?

Der Fonds wird halbjährlich in Übereinstimmung mit der Häufigkeit der Neugewichtung des Index ebenfalls neu gewichtet.

Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?

Der bestimmte Index implementiert Ausschlüsse und Änderungen der Indexgewichtungen gegenüber dem relevanten breiten Marktindex, die von den ESG-Merkmalen der Unternehmen abhängen, wobei sowohl ESG-Ratings als auch die Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten berücksichtigt werden, wie vom Indexanbieter S&P Dow Jones Indices LLC („SPDJI“) festgelegt. Informationen zur Indexmethodik, die bei der Konstruktion des Index verwendet wird, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von SPDJI.

Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?

Die Beschreibung der Indexmethodik von S&P finden Sie unter dem folgenden Link:
<https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-esg-divarist-indices.pdf>.

Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:

Anlagen in SPDR Exchange Traded Funds (ETFs) ([ssga.com](https://www.ssga.com))



State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF

DER STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED QUALITY INCOME INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED QUALITY INCOME INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET CORPORATION ODER DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED QUALITY INCOME INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED QUALITY INCOME INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED QUALITY INCOME INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED QUALITY INCOME INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED QUALITY INCOME INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED QUALITY INCOME INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED QUALITY INCOME INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (U. A. EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P GLOBAL DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED QUALITY INCOME INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P Global Dividend Aristocrats Screened Quality Income Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als Administrator gemäß Artikel 33 der Benchmark-Verordnung eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF

Nachtrag Nr. 63

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untieranlageverwalter	State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März, Juni, September und Dezember), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem alleinigen Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel 8-Fonds, vom Index einbezogenes Nachhaltigkeitsrisiko

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für alle Zeichnungen und Rücknahmen: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am ersten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P High Yield Dividend Aristocrats Screened Index (SPEHYDUN)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Vierteljährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/dividends-factors/sp-high-yield-dividend-aristocrats-screened-index/#overview/ https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF

Anteilklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD	
Index Ticker	SPEHYDUN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,35 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Teilfonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von bestimmten hohe Dividenden ausschüttenden Aktienwerten im US-Aktienmarkt.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus dem US-Aktienmarkt, welche die im S&P High Yield Dividend Aristocrats Index (der „Standardindex“) definierten Zulassungskriterien erfüllen. Ferner ist der Index darauf ausgerichtet, bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale auszuschließen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen geschäftlichen Tätigkeiten berücksichtigt wird, wie in der Indexmethodik angegeben. Im Anschluss werden die verbleibenden Wertpapiere nach der Höhe ihrer Dividenden gewichtet.

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet. Der Index schließt im Vergleich zum Universum des Standardindex mindestens 20 % der Wertpapiere mit dem niedrigsten Rating aus. Daher ist davon auszugehen, dass das resultierende ESG-Rating des Fonds höher ausfällt als das ESG-Rating eines Fonds, der den Standardindex nachbildet.

Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Die Übernahme dieser Filter im Index entspricht den vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Faktoren, wie im Unterabschnitt „**ESG-Screening**“ des Abschnitts „**ESG-Anlagen**“ des Prospekts näher beschrieben. Unternehmen, die nach Einschätzung des Indexanbieters in Bezug auf die Prinzipien des UN Global Compact keine ausgesprochen schlechten Leistungen bringen, gelten als eine gute Unternehmensführung aufweisend. Die wichtigsten methodischen Grenzen werden im Unterabschnitt „**Screening-Risiken**“ des Abschnitts „**Anlagerisiken**“ dieses Nachtrags beschrieben.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Limits erlauben es dem Fonds, Positionen in einzelnen Komponenten des Index,

die vom selben Emittenten begeben wurden, in Höhe von bis zu 20 % zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. In diesem Fall kann die Bewertung der Nachhaltigkeitsmerkmale für diese ausgewählten Wertpapiere nicht garantiert werden. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Ab dem Datum dieses Nachtrags berücksichtigen der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf der Fondsebene, um durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachte negative externe Effekte möglichst zu reduzieren.

Dieser Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 SFDR. Weitere Informationen über die ökologischen und sozialen Merkmale sind dem Anhang dieses Nachtrags zu entnehmen.

Taxonomie-Verordnung. Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Fonds ist nicht verpflichtet, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in taxonomiekonforme Anlagen zu investieren.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene

Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI durch den Fonds beschränkt sich auf Futures. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Derzeit beteiligt sich der Fonds nicht an einem Wertpapierleihprogramm, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt. Sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung dieser Politik beschließen, werden die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die

Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf einen bestimmten Markt oder eine geringe Zahl von Aktien, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten dieses Marktes oder dieser Aktien betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Markt oder eine geringe Zahl von Aktien, auf den/die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Screening-Risiken: Es besteht ein Risiko von Fehlern seitens des Indexanbieters, etwa eine falsche Beurteilung der in der Anlagepolitik beschriebenen Screening-Kriterien und/oder die Aufnahme der falschen/der Ausschluss der richtigen Komponenten im Screening-Prozess. ESG-Scoring und -Screening unterliegen inhärenten methodischen Grenzen. Eine Beurteilung von ESG-Kriterien durch einen Index basiert auf den von Dritten bereitgestellten Daten. Diese Beurteilungen sind von Informationen und Daten abhängig, die unvollständig, unrichtig oder nicht verfügbar sein können, was zu einer falschen Beurteilung der ESG-Performance eines Emittenten führen kann. Insbesondere können Unstimmigkeiten, Ungenauigkeiten oder mangelnde Verfügbarkeit erforderlicher ESG-Daten auftreten, insbesondere, wenn diese von externen Datenlieferanten herausgegeben werden. Diese Grenzen können insbesondere Probleme umfassen im Zusammenhang mit:

- fehlenden oder unvollständigen Daten von Unternehmen (beispielsweise in Bezug auf deren Fähigkeit, ihre Nachhaltigkeitsrisiken zu managen), die als Eingabedaten für ein Scoring-Modell herangezogen wurden;
- die Quantität und die Qualität von zu verarbeitenden ESG-Daten; und

- die Ermittlung relevanter Faktoren für die ESG-Analyse.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken seitens des Index gewährleistet nicht die Minderung eines oder aller Nachhaltigkeitsrisiken. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko: Die Umsetzung des SFDR erfolgt schrittweise ab dem 10. März 2021 und führt neue Offenlegungspflichten für Teilnehmer der Finanzmärkte ein. Zum Datum dieses Prospekts wurden die technischen Regulierungsstandards zur Umsetzung (Stufe 2) für die SFDR von der Europäischen Kommission verabschiedet und gelten ab dem 1. Januar 2023, aber einige von der SFDR eingeführten Konzepte sind derzeit nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Der Fonds wurde in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Nachtrag und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Informationen und Klassifizierungen gemäß Artikel 8 Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus den USA suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF (Dist)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „**Erstausgabezeitraum**“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

SFDR-Anhang

ANHANG II

Vorlage – Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung: 549300LWZIW4LRZB5J07

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒	☐	Ja	☒	☐	Nein
☐	Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%		☐	Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 0 % an nachhaltigen Investitionen	
☐	in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind		☐	mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	
☐	in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind		☐	mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	
☐	Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%		☒	mit einem sozialen Ziel	
☐	Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt		☒	Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt	

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Der State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF ist ein Indexfonds, der die Wertentwicklung des S&P U.S. Screened High Yield Dividend Aristocrats Index (der „Index“) nachbildet. Der Index wurde zu dem Zweck bestimmt, die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen. Der Index repräsentiert die Wertentwicklung gewisser dividendenstarker Aktien des US-Aktienmarktes, wobei bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale ausgeschlossen werden, und zwar sowohl im Hinblick auf ihr ESG-Rating als auch auf ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten (in der Indexmethodik beschrieben).



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanz-



Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Der Index repräsentiert die Wertentwicklung gewisser dividendenstarker Aktienwerte, die von hohe

produkt beworbenen
ökologischen oder
sozialen Merkmale
erreicht werden.

Dividenden ausschüttenden Unternehmen aus dem US-Aktienmarkt begeben werden, wobei bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale ausgeschlossen werden, und zwar sowohl im Hinblick auf ihr ESG-Rating als auch auf ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten. Folglich wird die Erreichung der damit verbundenen ökologischen und sozialen Merkmale durch den Ausschluss von Unternehmen aus dem Index gemessen, die mit kontroversen Waffen, Kraftwerkskohle, Tabakprodukten, Ölsanden, Kleinwaffen und militärischen Aufträgen in Verbindung gebracht werden, sowie von Unternehmen, die die UNGC-Grundsätze nicht einhalten.

Daher beabsichtigt der Fonds nicht, Wertpapiere zu halten, die die oben genannten maßgeblichen ESG-Kriterien nicht erfüllen.

Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht anwendbar

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht anwendbar

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht anwendbar

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigelegt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Ja,



Der Fonds strebt eine Reduzierung der durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachten negativen externen Effekte an. Er berücksichtigt in diesem Zusammenhang die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Adverse Impacts, „PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er normbasierte ESG-Filter innerhalb des Index anwendet. Der Fonds berücksichtigt insbesondere:

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze
- Engagement in umstrittenen Waffen

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus dem US-Aktienmarkt, welche die im S&P High Yield Dividend Aristocrats Index (der „Standardindex“) definierten Zulassungskriterien erfüllen. Ferner ist der Index darauf ausgerichtet, bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale auszuschließen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen geschäftlichen Tätigkeiten berücksichtigt wird, wie in der Indexmethodik angegeben. Im Anschluss werden die verbleibenden Wertpapiere nach der Höhe ihrer Dividenden gewichtet.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index nachzubilden. Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet.

Ökologische und soziale Merkmale werden durch die Verwendung von Filtern gefördert, um Wertpapiere auszuschließen, die basierend auf spezifischen ESG-Kriterien mit bestimmten Sektoren, Unternehmen oder Praktiken verbunden sind.

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

Der Fonds schließt Anlagen in Emittenten aus, wie in der Anlagestrategie und den verbindlichen Anforderungen vorstehend dargelegt, sieht jedoch keinen festgelegten Mindestsatz vor, um den Umfang der Anlagen zu reduzieren.

Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?

Unternehmen, die nach Ansicht des Indexanbieters nicht gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen, gelten als Unternehmen mit einer guten Unternehmensführung. Informationen zu den Methoden, die bei der Konstruktion des Index verwendet werden, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von S&P, die unter folgendem Link abrufbar ist:

<https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-esg-divarist-indices.pdf>

Die **Anlagestrategie** dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Die Verfahrensweisen einer **guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

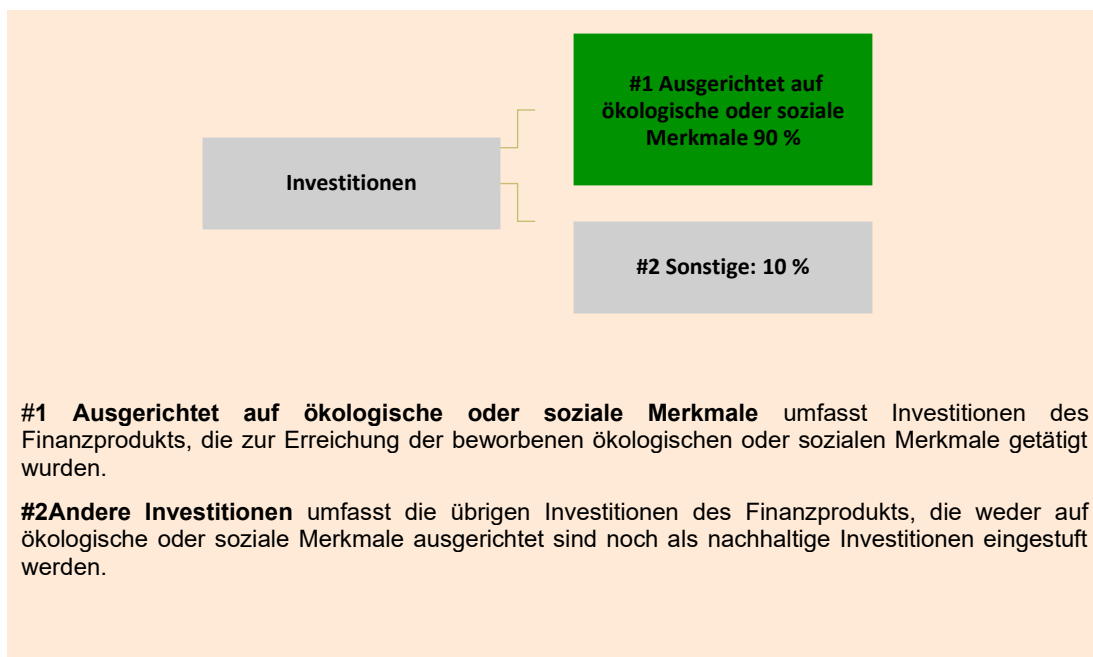
Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index enthalten und auf ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, während der Indexanbieter ESG-Ratings für alle Indexkomponenten anwendet. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen im Sinne der SFDR oder der Taxonomie-Verordnung. Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters 10 % seines Vermögens in Form von Zahlungsmitteln oder Zahlungsmitteläquivalenten und Derivaten halten, die für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden und die in der nachstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft würden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Soweit der Fonds ausschließlich zum Zweck des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzt, werden diese nicht zur Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Daher verpflichtet sich der Fonds nicht, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in Anlagen zu investieren, die der Taxonomie-Verordnung entsprechen. Daher ist zu beachten, dass dieser Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Taxonomie-Verordnung nicht berücksichtigt. Es ist daher keine Ausrichtung des Portfolios an der Taxonomie-Verordnung geplant. Aus diesem Grund gilt der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ für keine der Anlagen dieses Fonds und Es ist keine Ausrichtung an der Taxonomie-Verordnung beabsichtigt.

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ **Ja:**

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

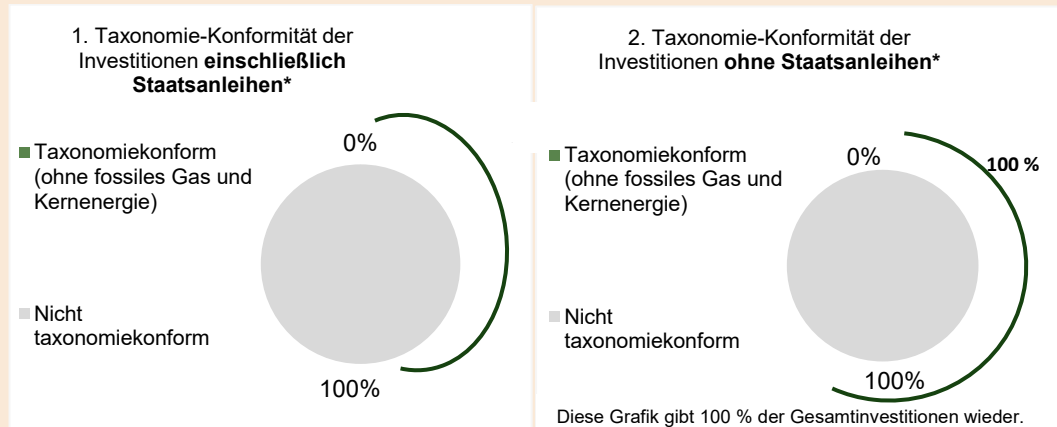
☒ **Nein**

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Der Fonds verpflichtet sich zu einem Mindestanteil an Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.



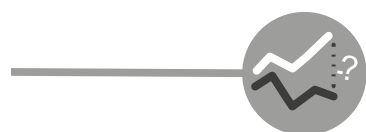
Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht anwendbar.



Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen Teil seines Vermögens in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten sowie Derivaten halten, die nach dem Ermessen des Anlageverwalters zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden und die in der vorstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft werden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.



Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Der Fonds bildet die Wertentwicklung des S&P High Yield Dividend Aristocrats Screened Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nach und

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

strebt danach, so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung dividendenstarker Aktien aus dem US-Aktienmarkt, welche die im S&P High Yield Dividend Aristocrats Index (der „Standardindex“) definierten Zulassungskriterien erfüllen. Ferner ist der Index darauf ausgerichtet, bestimmte Aktien aufgrund ihrer ESG-Merkmale auszuschließen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen geschäftlichen Tätigkeiten berücksichtigt wird, wie in der Indexmethodik angegeben.

Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?

Die Indexmethodik sieht eine vierteljährliche Überprüfung und Neugewichtung vor.

Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?

Der Fonds wird vierteljährlich in Übereinstimmung mit der Häufigkeit der Neugewichtung des Index ebenfalls neu gewichtet.

Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?

Der bestimmte Index implementiert Ausschlüsse und Änderungen der Indexgewichtungen gegenüber dem relevanten breiten Marktindex, die von den ESG-Merkmalen der Unternehmen abhängen, wobei sowohl ESG-Ratings als auch die Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten berücksichtigt werden, wie vom Indexanbieter S&P Dow Jones Indices LLC („SPDJ“) festgelegt. Informationen zur Indexmethodik, die bei der Konstruktion des Index verwendet wird, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von SPDJI.

Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?

Die Beschreibung der Indexmethodik von S&P finden Sie unter dem folgenden Link: <https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-esg-divarist-indices.pdf>.

Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:

[Anlagen in SPDR Exchange Traded Funds \(ETFs\) \(ssga.com\)](https://www.ssga.com)



State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF

DER STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P U.S. HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET CORPORATION ODER DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P U.S. HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND SCREENED ARISTOCRATS INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P U.S. DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P U.S. HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (U. A. EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P HIGH YIELD DIVIDEND ARISTOCRATS SCREENED INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P High Yield Dividend Aristocrats Screened Index

Zum Datum des Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register der Referenzwerte aus Drittstaaten (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als in Einklang mit Artikel 33 der Benchmark-Verordnung anerkannter Administrator eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

© 2026 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF

Nachtrag Nr. 65

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF

Fondsmerkmale

Basiswährung	EUR
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel 8-Fonds, vom Index einbezogenes Nachhaltigkeitsrisiko

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 year Ex-Controversies Select Index (I36753EU).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	EUR nicht abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		USD abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored CHF Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored USD Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteils-klasse	EUR		GBP		CHF		USD	
Währungsgesicherte r Index	k. A.		Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 year Ex-Controversies Select Index (GBP hedged)		Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 year Ex-Controversies Select Index (CHF hedged)		Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 year Ex-Controversies Select Index (USD hedged)	
Index Ticker	I36753EU		H36753GB		H36753CH		H36753US	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,12 %		Bis zu 0,17 %		Bis zu 0,17 %		Bis zu 0,17 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds besteht darin, den Anlegern eine Gesamtrendite unter Berücksichtigung von Erträgen und Veräußerungsgewinnen zu bieten, die im Allgemeinen die Rendite des Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 year Ex-Controversies Select Index widerspiegelt.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index ist ein Vergleichsmaßstab für auf Euro lautende festverzinsliche Wertpapiere mit Investment Grade, der seinen R-Factor™-Wert optimiert, ein Rating zu den Faktoren Umwelt, Soziales und Governance („ESG“), das von State Street Global Advisors® bereitgestellt wird. Auf der Grundlage des Bloomberg Euro Corporate 0-3 Year Index (der „Euro Corporate 0-3 Index“) wählt der Index Wertpapiere aus, die für den Euro Corporate 0-3 Index in Frage kommen. Im Anschluss zielt er dann darauf ab, bestimmte Emittenten aufgrund ihrer ESG-Merkmale auszuschließen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten (beschrieben in der Indexmethodik) berücksichtigt werden. Anschließend gewichtet der Index die Wertpapiere mithilfe eines Optimierungsprozesses zwecks Maximierung des ESG-Ratings des Portfolios und zur gleichzeitigen Kontrolle des aktiven Gesamtrisikos. Das aktive Gesamtrisiko bezieht sich auf die Abweichung zwischen dem Index und dem Euro Corporate 0-3 Index.

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet. Nach Anwendung eines Filters, mit dem mindestens 20 % der Wertpapiere aus dem Euro Corporate 0-3 Index mit dem schlechtesten ESG-Rating eliminiert werden, wird das sich daraus ergebende ESG-Rating des Portfolios voraussichtlich höher sein als das ESG-Rating des Portfolios des Euro Corporate 0-3 Index.

Die Übernahme dieser Filter und „Best-in-Class“-Kriterien im Index entsprechen den vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Faktoren, wie in den Unterabschnitten „ESG-Screening“ und „Best-in-Class-ESG-Anlagen“ des Abschnitts „ESG-Anlagen“ des Prospekts näher beschrieben. Unternehmen, die nach Einschätzung des Indexanbieters den Prinzipien des United Nations Global Compact entsprechen, gelten als eine gute Unternehmensführung aufweisend. Die wichtigsten methodischen Grenzen werden im Unterabschnitt „Screening-Risiken“ des Abschnitts „Anlagerisiken“ dieses Nachtrags beschrieben.

Der Index misst die Wertentwicklung des Marktes für auf kurz laufende auf Euro lautende Unternehmensanleihen. Nur Anleihen mit einer Laufzeit von unter drei Jahren werden aufgenommen, und alle im Index enthaltenen Anleihen bleiben bis zur Fälligkeit im Index. Die Aufnahme in den Index erfolgt auf Basis der Emissionswährung, nicht auf Basis des Sitzes des Emittenten. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als

es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investieren für den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. In diesem Fall kann die Bewertung der Nachhaltigkeitsmerkmale für diese ausgewählten Wertpapiere nicht garantiert werden. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Ab dem Datum dieses Nachtrags berücksichtigen der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf der Fondsebene, um durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachte negative externe Effekte möglichst zu reduzieren.

Dieser Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 SFDR. Weitere Informationen über die ökologischen und sozialen Merkmale sind dem Anhang dieses Nachtrags zu entnehmen.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Taxonomie-Verordnung. Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Der Grundsatz

„Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ besitzt nur für die dem Fonds zugrunde liegenden Anlagen Gültigkeit, die den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten Rechnung tragen. Die dem verbleibenden Teil dieses Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Fonds ist nicht verpflichtet, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in taxonomiekonforme Anlagen zu investieren.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, kann es sich um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen sowie Unternehmensanleihen handeln.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Derzeit beteiligt sich der Fonds nicht an einem Wertpapierleihprogramm, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt. Sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung dieser Politik beschließen, werden die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird

davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditschwierigkeiten unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters bzw. des Unteranlageverwalters dennoch weiter halten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten

Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Screening-Risiken: Es besteht ein Risiko von Fehlern seitens des Indexanbieters, etwa eine falsche Beurteilung der in der Anlagepolitik beschriebenen Screening-Kriterien und/oder die Aufnahme der falschen/der Ausschluss der richtigen Komponenten im Screening-Prozess. ESG-Scoring und -Screening unterliegen inhärenten methodischen Grenzen. Eine Beurteilung von ESG-Kriterien durch einen Index basiert auf den von Dritten bereitgestellten Daten. Diese Beurteilungen sind von Informationen und Daten abhängig, die unvollständig, unrichtig oder nicht verfügbar sein können, was zu einer falschen Beurteilung der ESG-Performance eines Emittenten führen kann. Insbesondere können Unstimmigkeiten, Ungenauigkeiten oder mangelnde Verfügbarkeit erforderlicher ESG-Daten auftreten, insbesondere, wenn diese von externen Datenlieferanten herausgegeben werden. Diese Grenzen können insbesondere Probleme umfassen im Zusammenhang mit:

- fehlenden oder unvollständigen Daten von Unternehmen (beispielsweise in Bezug auf deren Fähigkeit, ihre Nachhaltigkeitsrisiken zu managen), die als Eingabedaten für ein Scoring-Modell herangezogen wurden;
- die Quantität und die Qualität von zu verarbeitenden ESG-Daten;
- die Ermittlung relevanter Faktoren für die ESG-Analyse.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken seitens des Index gewährleistet nicht die Minderung eines oder aller Nachhaltigkeitsrisiken. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko: Die Umsetzung des SFDR erfolgt schrittweise ab dem 10. März 2021 und führt

neue Offenlegungspflichten für Teilnehmer der Finanzmärkte ein. Zum Datum dieses Prospekts wurden die technischen Regulierungsstandards zur Umsetzung (Stufe 2) für die SFDR von der Europäischen Kommission verabschiedet und gelten ab dem 1. Januar 2023, aber einige von der SFDR eingeführten Konzepte sind derzeit nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Der Fonds wurde in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Nachtrag und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Informationen und Klassifizierungen gemäß Artikel 8 Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für kurz laufende, auf Euro lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „**Erstausgabezeitraum**“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

SFDR-Anhang

ANHANG II

Vorlage – Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung: 549300ZOZNY8CER0YP19

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☒	☐ Ja	☒ ☐	☒ Nein
☐	Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%	☐	Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von <u>0</u> % an nachhaltigen Investitionen
☐	☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐	☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐	☐ Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☒	☐ mit einem sozialen Ziel
☒	Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt		

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Faktoren sind diejenigen, die zu den R-Factor™-Scores beitragen, die auf Indexkomponenten einschließlich des Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 year Ex-Controversies Select Index (der „Index“) angewandt werden. Sie basieren auf einer Bewertung und einem Rating des Indexanbieters für verschiedene ökologische, soziale und Unternehmensführungsmerkmale der Unternehmen im Indexuniversum.

Weitere Informationen über R-Factor™-Scores finden Sie auf der SSGA-Website: https://www.ssga.com/uk/en_gb/intermediary/ic/capabilities/esg/data-scoring/r-factor-transparent-esg-scoring#:~:text=R%2DFactor%E2%84%A2%20is%20the,materiality%20in%20the%20scoring%20process. Des Weiteren schließt der Index Emittenten aus, die mit extrem umstrittenen Ereignissen, kontroversen Waffen, Verstößen gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC“), zivilen Schusswaffen, der Förderung und Verstromung von Kraftwerkskohle, der Gewinnung von Ölsanden, der Exploration von arktischem Öl und Gas und Tabakunternehmen in Verbindung gebracht werden.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Die Nachhaltigkeitsindikatoren, mit denen die Erreichung der einzelnen von diesem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale gemessen wird, basieren auf dem Index, der ein ESG-Rating optimiert, das sich aus einem Verantwortungsfaktor („Responsibility Factor“, „R-Factor™“) zusammensetzt. Der R-Faktor™ geht bei der ESG-Bewertung so vor, dass er das gesamte Spektrum der „finanziell wesentlichen“ Messgrößen erfasst, um die langfristigen Nachhaltigkeitstreiber für den Wert in den Bereichen Umwelt, Humankapital, Sozialkapital, Geschäftsmodell, Management und Unternehmensführung zu isolieren.

Die Bewertungsmethode bezieht systematisch Best-in-Class-Daten, einen transparenten Nachhaltigkeitsrahmen und branchenübergreifende finanzielle Wesentlichkeit ein, um einen R-Factor™-Score für jedes Unternehmen zu bestimmen.

Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht anwendbar

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht anwendbar

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht anwendbar

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Ja,



Der Fonds strebt eine Reduzierung der durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachten negativen externen Effekte an. Er berücksichtigt in diesem Zusammenhang die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Adverse Impacts, „PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er normbasierte ESG-Filter innerhalb des Index anwendet. Der Fonds berücksichtigt insbesondere:



- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze
 - Engagement in umstrittenen Waffen
- Weitere Informationen zu den PAI finden Sie in den regelmäßigen Fondsberichten.

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der Index-Wertentwicklung zu minimieren.

Der Index ist eine Benchmark für auf Euro lautende, festverzinsliche Wertpapiere mit Investment Grade (hohe Qualität), die ihren R-Factor™-Score, ein von State Street Global Advisors® bereitgestelltes Rating für ökologische, soziale und Unternehmensführungsmerkmale („ESG“), optimiert. Auf der Grundlage des Bloomberg Euro Corporate 0-3 Year Index (der „Euro Corporate 0-3 Index“) wählt der Index Wertpapiere aus, die für den Euro Corporate 0-3 Index in Frage kommen. Im Anschluss zielt er dann darauf ab, bestimmte Emittenten aufgrund ihrer ESG-Merkmale auszuschließen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch ihre Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten (beschrieben in der Indexmethodik) berücksichtigt werden.

Anschließend gewichtet der Index die Wertpapiere mithilfe eines Optimierungsprozesses zwecks Maximierung des ESG-Ratings des Portfolios und zur gleichzeitigen Kontrolle des aktiven Gesamtrisikos. Das aktive Gesamtrisiko bezieht sich auf die Abweichung zwischen dem Index und dem Euro Corporate 0-3 Index.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter investiert im Namen des Fonds unter Anwendung der im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ des Prospekts näher beschriebenen Strategie stratifizierter Stichproben in erster Linie in die Wertpapiere des Index, und zwar jederzeit in Übereinstimmung mit den im Prospekt dargelegten Anlagebeschränkungen.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index nachzubilden. Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet.

Ökologische und soziale Merkmale werden durch die Verwendung von Filtern beworben, um Wertpapiere auszuschließen, die mit bestimmten Sektoren, Unternehmen oder Praktiken in Verbindung stehen. Sie basieren auf spezifischen ESG-Kriterien und Best-in-Class-ESG-Performance im Vergleich zu Anlageuniversen und/oder im Branchenvergleich, wenn sie anhand objektiver Kriterien innerhalb des Index bewertet werden.

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

Der Fonds schließt Anlagen in Emittenten aus, wie in der Anlagestrategie und den verbindlichen Anforderungen vorstehend dargelegt, sieht jedoch keinen festgelegten Mindestsatz vor, um den Umfang der Anlagen zu reduzieren.

Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?

Unternehmen, die nach Ansicht des Indexanbieters nicht gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen, gelten als Unternehmen mit einer guten Unternehmensführung. Informationen zu den Methoden, die bei der Konstruktion des Index verwendet werden, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von Bloomberg, die unter folgendem Link abrufbar ist:

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index enthalten und auf ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, während der Indexanbieter ESG-Ratings für alle Indexkomponenten anwendet. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen im Sinne der SFDR oder der Taxonomie-Verordnung. Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters 10 % seines Vermögens in Form von Zahlungsmitteln oder Zahlungsmitteläquivalenten und Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden, und die in der nachstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft würden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.

Die **Anlagestrategie** dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Die Verfahrensweisen einer **guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.



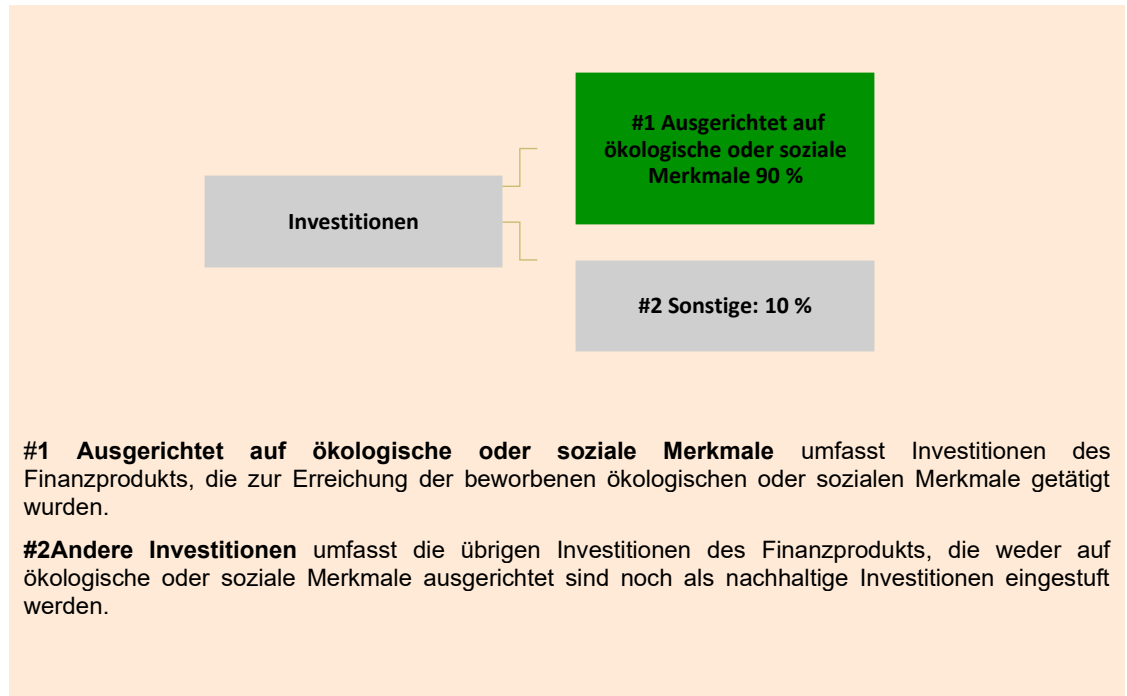
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Soweit der Fonds ausschließlich zum Zweck der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzt, werden diese nicht zur Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Daher verpflichtet sich der Fonds nicht, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in Anlagen zu investieren, die der Taxonomie-Verordnung entsprechen. Daher ist zu beachten, dass dieser Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Taxonomie-Verordnung nicht berücksichtigt. Es ist daher keine Ausrichtung des Portfolios an der Taxonomie-Verordnung geplant. Aus diesem Grund gilt der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ für keine der Anlagen dieses Fonds und

Es ist keine Ausrichtung an der Taxonomie-Verordnung beabsichtigt.

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles

Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja:

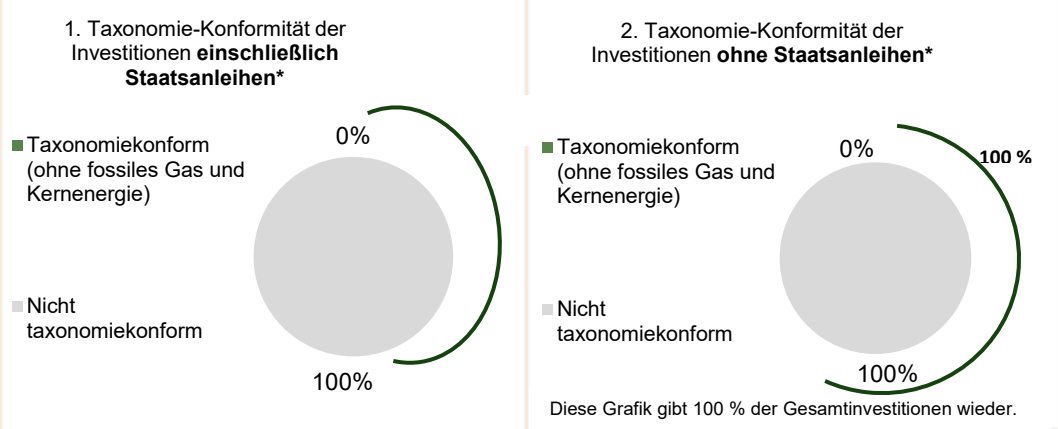
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Der Fonds verpflichtet sich zu einem Mindestanteil an Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten.

Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht anwendbar.

Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen Teil seines Vermögens in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten sowie in Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden und

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

die in der vorstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft werden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Der Fonds bildet die Wertentwicklung des Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 year Ex-Controversies Select Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so weit wie möglich nach und strebt danach so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren. Der Index ist eine Benchmark für auf Euro lautende, festverzinsliche Wertpapiere mit Investment Grade, die ihren R-Factor™-Score, ein von State Street Global Advisors® bereitgestelltes Rating (wie oben beschrieben), optimiert.

Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?

Die Indexmethodik sieht eine monatliche Überprüfung und Neugewichtung vor.

Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?

Der Fonds wird monatlich in Übereinstimmung mit der Häufigkeit der Neugewichtung des Index ebenfalls neu gewichtet.

Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?

Der bestimmte Index implementiert Ausschlüsse und Änderungen der Indexgewichtungen gegenüber dem relevanten breiten Marktindex, die von den ESG-Merkmalen der Unternehmen abhängen, wobei sowohl ESG-Ratings als auch die Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten berücksichtigt werden, wie vom Indexanbieter Bloomberg festgelegt. Informationen zur Indexmethodik, die bei der Konstruktion des Index verwendet wird, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von Bloomberg.

Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:

[Anlagen in SPDR Exchange Traded Funds \(ETFs\) \(ssga.com\)](https://www.ssga.com)



BLOOMBERG® und Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 year Ex-Controversies Select Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 Year Ex-Controversies Select Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 year Ex-Controversies Select Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Scored UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG SASB SCORED EURO CORPORATE 0-3 YEAR EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 0-3 YEAR EURO CORPORATE SCORED UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG SASB EURO CORPORATE 0-3 YEAR SCORED EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG SASB SCORED EURO CORPORATE 0-3 YEAR EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT

ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTE ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 0-3 YEAR EURO CORPORATE SCORED UCITS ETF ODER DEM BLOOMBERG SASB SCORED EURO CORPORATE 0-3 YEAR EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 year Ex-Controversies Select Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 year Ex-Controversies Select Index verwenden.

SASB® vertritt in Bezug darauf, ob ein Emittent in den Bloomberg SASB Scored Euro Corporate 0-3 year Ex-Controversies Select Index aufgenommen oder von diesem ausgeschlossen werden sollte, keinen Standpunkt.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc

19. Februar 2026

State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 66

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für alle Zeichnungen und Rücknahmen: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	J.P.Morgan Saudi Arabia Aggregate Index (JPEIAGTR)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.jpmmorgan.com/insights/global-research/index-research/composition

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussmittelkurse für auf USD lautende Instrumente, Schlussmittelkurse für auf Saudi-Riyal („ SAR “) lautende Instrumente.
Bewertungszeitpunkt	16:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		SGD abgesichert	
Name	State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond UCITS ETF		State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond USD Base CCY Hdg to EUR UCITS ETF		State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond USD Base CCY Hdg to GBP UCITS ETF		State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond USD Base CCY Hdg to CHF UCITS ETF		State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond USD Base CCY Hdg to SGD UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF		SGD	
Währungsgesiche-ter Index	k. A.		JPM Saudi Arabia Aggregate Index unhedged USD base hedged into EUR		JPM Saudi Arabia Aggregate Index unhedged USD base hedged into GBP		JPM Saudi Arabia Aggregate Index unhedged USD base hedged into CHF		JPM Saudi Arabia Aggregate Index unhedged USD base hedged into SGD	
Index Ticker	JPEIAGTR		JPEIAGHE		JPEIAGHG		JPEIAGHC		JPEIAGHS	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,37 %		Bis zu 0,42 %		Bis zu 0,42 %		Bis zu 0,42 %		Bis zu 0,42 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von liquiden, auf USD lautenden staatlichen und quasi-staatlichen Instrumenten und auf SAR lautenden Sukuk-Staatsanleihen aus Saudi-Arabien.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung von liquiden, auf USD lautenden staatlichen und quasi-staatlichen Instrumenten und auf SAR lautenden Sukuk-Staatsanleihen aus Saudi-Arabien. Der Index umfasst auf USD lautende festverzinsliche, variabel verzinsliche und Nullkuponanleihen, Kapitalisierungs-/Tilgungsanleihen und Anleihen mit Kündigungs- Rückkaufs oder Wandlungsrechten. Darüber hinaus können auf SAR lautende Sukuk-Staatsanleihen, die nach dem 1. Januar 2023 aufgelegt wurden, in den Index aufgenommen werden. Auf USD und SAR lautende Anleihen müssen einen ausstehenden Betrag von mindestens 500 Mio. USD bzw. 1 Mrd. USD aufweisen. An jedem Monatsende werden Instrumente, deren Restlaufzeit in dem kommenden Monat unter 6 Monate fällt, aus dem Index ausgeschlossen.

Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Grenzen erlauben dem Fonds, Positionen bis maximal 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds in vom selben Emittenten ausgehenden einzelnen Indexkomponenten zu halten.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Währung, auf die die jeweilige abgesicherte Anteilsklasse lautet, und der Basiswährung des Fonds zu mindern. Dies beinhaltet die Absicherung der Basiswährung des Fonds in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse ohne Bezugnahme auf die im zugrunde liegenden Anlageportfolio des Fonds repräsentierten Währungen. Abgesicherte Anteilsklassen bilden in der Regel den entsprechenden währungsgesicherten Index genauer nach als den Index.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten,

richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Für die Zwecke von Absatz 2.12 des Prospektabschnitts „Anlagebeschränkungen“ kann der Fonds 100 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente investieren, die vom Königreich Saudi-Arabien emittiert oder garantiert werden (vorausgesetzt es handelt sich dabei um Emissionen mit Investment Grade).

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen abgesicherten Anteilsklasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser abgesicherten Anteilsklasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der abgesicherten Anteilsklasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Die Wertpapiere, in die der Fonds investiert, können auf USD lautende staatliche und quasi-staatliche Instrumente und auf SAR lautende Sukuk-Staatsanleihen aus Saudi-Arabien umfassen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem

angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Derzeit beteiligt sich der Fonds nicht an einem Wertpapierleihprogramm, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt. Sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung dieser Politik beschließen, werden die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen und insbesondere die Risiken, die in Bezug auf Anlagen in Saudi-Arabien darin dargelegt werden, zur Kenntnis nehmen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquiden Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung oder Region, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung oder aus dieser Region betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung oder Region, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen. Der SAR notiert zu einem festen Wechselkurs im Verhältnis zum US-Dollar. (Er ist fest an den US-Dollar gebunden). Wie lange die Wechselkursbindung Bestand hat oder welche Auswirkungen die Einrichtung eines alternativen Wechselkurssystems auf die Wirtschaft des KSA hätte, ist jedoch ungewiss. Die Bewertung der Währungsabsicherungen kann durch jede Änderung am bisherigen Wechselkurssystem beeinflusst werden.

Schwellenländerisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe. **Da der Fonds wesentlich in Schwellenmärkten engagiert ist, sollte eine Anlage im Fonds keinen bedeutenden Anteil am**

Anlageportfolio darstellen und ist unter Umständen nicht für jeden Anleger geeignet.

Qualifikationskriterien für Anlagen in Staatsanleihen oder staatlichen Instrumenten aus Saudi-Arabien: Die Zulassungskriterien für Anlagen in Staatsanleihen oder staatlichen Instrumenten aus Saudi-Arabien können sich ändern, und es kann nicht zugesichert werden, dass alle solche Angebote für den Fonds verfügbar sind.

Sukuk-Anlagerisiko: Preisänderungen bei Sukuk-/Scharia-konformen Instrumenten werden vorwiegend durch den Wert des zugrunde liegenden Vermögenswerts beeinflusst. Zu den Faktoren, die den Wert des zugrunde liegenden Vermögenswerts beeinflussen können, gehören Volatilität und das Zinsniveau. Sukuk-Preisänderungen können auch durch die Zinsentwicklungen an den Kapitalmärkten beeinflusst werden, die ihrerseits unter dem Einfluss von makroökonomischen Faktoren stehen. Sukuk können durch einen Anstieg der Kapitalmarktzinsen negativ beeinflusst werden, während ihr Wert steigen könnte, wenn die Kapitalmarktzinsen sinken. Die Preisänderungen hängen zudem von der Laufzeit oder der Restlaufzeit der Sukuk ab. Im Allgemeinen unterliegen Sukuk mit kürzeren Laufzeiten weniger Preisrisiken als Sukuk mit längeren Laufzeiten. Ihre Renditen sind jedoch generell niedriger und sie sind aufgrund der häufigeren Fälligkeitsdaten der Wertpapierportfolios mit höheren Wiederanlagekosten verbunden. Sukuk können von Unternehmen, Staaten oder supranationalen Organisationen ausgegeben werden und von beliebigen physischen oder anderweitigen Vermögenswerten, einschließlich Hypothekenkrediten, unterlegt sein oder ihren Wert daraus ableiten. Sovereign Sukuk („**Sovereign Sukuk**“) sind Sukuk, die von Staaten oder staatsnahen Organisationen ausgegeben oder garantiert werden. Die Anlagen in Sovereign Sukuk, die von Staaten bzw. deren Behörden oder Stellen („**staatliche Stellen**“) ausgegeben oder garantiert werden, können aufgrund ihrer geografischen Konzentration mit höheren Risiken verbunden sein als klassische Staatsanleihen. Die staatliche Stelle, welche die Rückzahlung von Sovereign Sukuk kontrolliert, ist unter Umständen nicht in der Lage oder willens, das Kapital und/oder die Rendite bei Fälligkeit gemäß den Bedingungen solcher Schuldtitel aufgrund von spezifischen Faktoren zurückzuzahlen, die insbesondere unter anderem (i) ihre Auslandsreserven, (ii) die zum Zeitpunkt ihrer Rückzahlung verfügbare Höhe an Devisen, (iii) ihre Unfähigkeit zur Durchführung von politischen Reformen und (iv) ihre Politik im Hinblick auf den Internationalen Währungsfonds umfassen können. Inhaber von Sovereign Sukuk können zudem durch zusätzliche für staatliche Emittenten geltende Einschränkungen beeinträchtigt sein, unter anderem: (i) die einseitige Umschuldung einer solchen Anleihe durch den Emittenten und (ii) die begrenzten Rechtsbehelfe, die (im Fall von nicht erfolgter oder verzögerter Rückzahlung) gegen den Emittenten geltend gemacht werden können. Wenn der Fonds in Sovereign Sukuk investiert, die von Staaten oder staatlichen Stellen aus Schwellenländern ausgegeben werden, unterliegt er zusätzlichen, mit den besonderen Merkmalen solcher Länder verbundenen Risiken (z. B. Währungsschwankungen, politische und wirtschaftliche Unsicherheiten, Rückführungen, Beschränkungen, Gesetzesänderungen usw.), wie weiter unter „**Schwellenländerisiko**“ in diesem Nachtrag dargelegt.

Unter Umständen bildet sich kein aktiver Sekundärmarkt für die Sukuk, in die der Fonds investiert, heraus oder der

Sekundärmarkt ist illiquide, was den Wert, zu dem der Fonds solche Sukuk verkaufen könnte, nachteilig beeinflussen würde. Es kann nicht zugesichert werden, dass bei dem Handel bzw. in den Clearing- oder Abrechnungsverfahren von an der saudischen Börse notierten Sukuk keine Unterbrechungen oder Fehler auftreten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für auf USD lautende staatliche und quasi-staatliche Instrumente und auf SAR lautende Sukuk-Staatsanleihen aus Saudi-Arabien eingehen wollen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds, in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond UCITS ETF (Acc); und

State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond UCITS ETF

State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate
Bond USD Base CCY Hdq to EUR UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 30 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond UCITS ETF

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von J.P. Morgan Securities LLC:

Zum Datum dieses Nachtrags ist J.P. Morgan Securities LLC gemäß Artikel 32 des FCA (UK BMR) Register als Benchmark-Administrator anerkannt. Da die Benchmark-Verordnung derzeit von der ESMA und den europäischen Gesetzgebern überarbeitet wird, wurde die Übergangsfrist für die Registrierung bis zum 31. Dezember 2025 verlängert.

Der State Street SPDR J.P. Morgan Saudi Arabia Aggregate Bond UCITS ETF (das „Finanzprodukt“) wird von JPMorgan Chase & Co und/oder seinen Konzerngesellschaften (zusammen „J.P. Morgan“) weder unterstützt noch verkauft oder beworben. J.P. Morgan ist nicht verantwortlich für Aspekte der Strukturierung von Merkmalen des Finanzprodukts, der Festlegung des Angebotszeitpunkts des Finanzprodukts, der Preisgestaltung des Finanzprodukts oder der Funktionsweise des Finanzprodukts, und ist daran auch nicht beteiligt. J.P. Morgan hat keinerlei Verpflichtung oder Verantwortung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des Finanzprodukts. Sämtliche hierin enthaltenen Informationen über die J.P. Morgan-Indizes (die „Indizes“), insbesondere unter anderem die Indexstände, dienen nur zu Informationszwecken. J.P. Morgan garantiert nicht die Vollständigkeit oder die Richtigkeit der Indizes und/oder die Vollständigkeit oder Richtigkeit von anderen Informationen, die in Verbindung mit den Indizes bereitgestellt werden. Die Indizes sind das ausschließliche Eigentum von J.P. Morgan, und J.P. Morgan behält sich alle Rechte daran vor. Keine der hierin enthaltenen Informationen begründet oder ist Teil eines Angebots oder einer Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten, einschließlich des Finanzprodukts, oder einer offiziellen Bestätigung einer Transaktion oder einer Bewertung oder eines Preises für die Indizes oder das Finanzprodukt. Keine hierin gemachten Angaben sollten als Empfehlung von J.P. Morgan zur Verfolgung einer Anlagestrategie oder als Rechts-, Steuer- oder Rechnungslegungsberatung verstanden werden. J.P. Morgan gibt keine ausdrücklichen oder stillschweigenden Erklärungen oder Zusicherungen in Bezug auf die Indizes und/oder das Finanzprodukt ab, einschließlich hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren oder Finanzprodukten allgemein und/oder den Finanzprodukten im Besonderen, oder der Eignung der Indizes, Anlagemöglichkeiten an den Finanzmärkten abzubilden oder ihr Ziel auf andere Weise zu erreichen. J.P. Morgan lehnt hiermit jegliche Gewährleistung für die allgemeine Marktgängigkeit oder Eignung für einen bestimmten Zweck in Bezug auf die Indizes und das Finanzprodukt ab. J.P. Morgan unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange des Emittenten oder Sponsors von Finanzprodukten, der Anleger, der Kontrahenten oder jeglicher anderen Partei bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung der J.P. Morgan-Indizes zu berücksichtigen. J.P. Morgan ist nicht für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder des Ausgabeumfangs dieses Finanzprodukts oder für die Festlegung oder Berechnung der Gleichung, anhand derer, oder des Betrages, gegen den Anteile dieses Finanzprodukts zurückgegeben werden können, verantwortlich und ist nicht daran beteiligt. Unbeschadet des Vorstehenden haftet J.P. Morgan in keinem Fall für unmittelbare, mittelbare, besondere Schäden, Strafschadenersatz, Folgeschäden oder sonstige Schäden (einschließlich entgangener Gewinne) gegenüber Personen, einschließlich insbesondere in Bezug auf Aussagen, die in den Angebotsunterlagen oder anderen Dokumenten enthalten sind, welche zur Beschreibung der Indizes und/oder des Finanzprodukts verwendet werden, für jegliche Fehler bei der Preisbestimmung, oder anderweitig, der Indizes und/oder des Finanzprodukts, und J.P. Morgan ist nicht verpflichtet, andere Personen über darin enthaltene Fehler zu informieren.

Die Indizes können ohne die vorherige schriftliche Genehmigung von J.P. Morgan nicht kopiert, verwendet oder vertrieben werden. J.P. Morgan und die Namen der J.P. Morgan-Indizes sind Dienstleistungsmarken von J.P. Morgan oder ihren Konzerngesellschaften und wurden zur Verwendung zu bestimmten Zwecken durch State Street Global Advisors Limited lizenziert. Kein Käufer, Verkäufer oder Inhaber dieses Wertpapiers, Produkts oder Fonds und keine anderen Personen oder Unternehmen sollten die Marken, Handelsnamen oder Dienstleistungsmarken von J.P. Morgan verwenden oder darauf verweisen, um dieses Finanzprodukt oder andere Finanzprodukte zu unterstützen, zu empfehlen, zu vermarkten oder zu bewerben, ohne sich zuvor mit J.P. Morgan in Verbindung zu setzen, um festzustellen, ob eine Genehmigung von J.P. Morgan erforderlich ist. Unter keinen Umständen darf eine Person oder ein Unternehmen ohne die vorherige schriftliche Genehmigung von J.P. Morgan wahrheitswidrig als zu J.P. Morgan zugehörig auftreten. Obwohl die Informationen aus als zuverlässig erachteten Quellen stammen, gewährleistet J.P. Morgan nicht deren Vollständigkeit oder Richtigkeit. Copyright 2024, J.P. Morgan Chase & Co. Alle Rechte vorbehalten.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc
19. Februar 2026

State Street SPDR S&P 500 Quality Aristocrats UCITS ETF

Nachtrag Nr.: 67

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P 500 Quality Aristocrats UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P 500 Quality Aristocrats UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März, Juni, September und Dezember), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem alleinigen Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

	Für Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung und Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag.
Orderannahmeschluss	Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung und Sachwerte am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am ersten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P 500 Quality FCF Aristocrats Index (SP5QFAUN)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Halbjährlich
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-qly-fcf-aristocrats-indices.pdf https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P 500 Quality Aristocrats UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Acc	Dist
Währung der Anteilsklasse	USD	
Index Ticker	SP5QFAUN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,25 %	

*Ausschüttungspolitik: „Acc“ = Thesaurierende Anteile; „Dist“ = Ausschüttende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von Large-Cap-Werten am US-amerikanischen Aktienmarkt.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung von US-Unternehmen, die im Vergleich zur Gesamtheit der Unternehmen im S&P 500 Index (der „**übergeordnete Index**“) Merkmale höherer Qualität aufweisen. Um als Unternehmen mit Merkmalen höherer Qualität in Betracht zu kommen, müssen Wertpapiere im übergeordneten Index zunächst das Kriterium eines über mehrere Jahre in Folge positiven freien Cashflows („**FCF**“) erfüllen. Dann werden aus den verbleibenden Wertpapieren die 100 Wertpapiere mit dem höchsten „Qualitäts-Score“ (auf Basis des 5-Jahres-Durchschnitts der FCF-Marge und des 5-Jahres-Durchschnitts der FCF-Rendite auf das investierte Kapital (FCF-ROIC), wie nachstehend beschrieben) als Indexkomponenten ausgewählt.

Als erster Schritt bei der Berechnung des „Qualitäts-Core“ werden zum Referenztag der Indexneugewichtung für jedes Wertpapier im Indexuniversum die beiden nachstehenden fundamentalen Kennzahlen berechnet. Diese werden wie folgt definiert:

- $\text{FCF-Marge} = \text{FCF} / \text{Umsatz}$
- $\text{Rendite auf das investierte Kapital („FCF-ROIC“)} = \frac{\text{FCF}}{(\text{Gesamtverschuldung} + \text{Gesamteigenkapital})}$

Hierbei ist:

- $\text{FCF} = \text{Nettokapitalfluss aus laufender Geschäftstätigkeit} - \text{Investitionsausgaben}$.

Im zweiten Schritt wird der 5-Jahres-Durchschnitt für die FCF-Marge und den FCF-ROIC berechnet. Fehlt ein Wert, so wird für die Berechnung des 5-Jahres-Durchschnitts der einfache Durchschnitt der übrigen Werte herangezogen.

Die Indexkomponenten werden durch Multiplikation der am Streubesitz orientierten Marktkapitalisierung mit dem Qualitäts-Score gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen. Weitere Details zum Qualitäts-Score entnehmen Sie bitte der Indexmethodik.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der

Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird,

ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der

Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine geringe Zahl von Aktien, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die diese geringe Zahl von Aktien betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine geringe Zahl von Aktien, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Large-Cap-Aktienmarktes in den USA suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art

verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P 500 Quality Aristocrats UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilkasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P 500 Quality FCF Aristocrats Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist SPDJI Limited im ESMA-Register (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als Administrator gemäß Artikel 33 der Benchmark-Verordnung eingetragen.

DER FONDS WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC, DEREN KONZERNGESELLSCHAFTEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER BEWORBEN. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN GESELLSCHAFTERN DES FONDS ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM FONDS IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P 500 QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. S&P ERTEILT DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) LIZENZEN FÜR BESTIMMTE MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE FÜR DEN S&P 500 QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG VON STATE STREET ODER DES FONDS FESTGELEGT, ZUSAMMENGESETZT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSTELLUNG ODER BERECHNUNG DES S&P 500 QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P 500 QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DER GESELLSCHAFTER BZW. ANTEILINHABER DES FONDS ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES FONDS UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES FONDS ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES FONDS ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES FONDS IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES FONDS. S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P 500 QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P 500 QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN GESELLSCHAFTERN ODER ANTEILINHABERN DES FONDS ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P 500 QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P 500 QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P 500 QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (UND INSBESONDERE FÜR ENTGANGENE GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P 500 QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

SSGA SPDR ETFs Europe I Plc
19. Februar 2026

State Street SPDR S&P Developed Quality Aristocrats UCITS ETF

Nachtrag Nr.: 68

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P Developed Quality Aristocrats UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P Developed Quality Aristocrats UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar, April, Juli und Oktober), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	Für Zeichnungen: 15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag, für Rücknahmen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P Developed Quality FCF Aristocrats Index (SPDQFAUN)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Halbjährlich
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-qly-fcf-aristocrats-indices.pdf https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P Developed Quality Aristocrats UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Acc	Dist
Währung der Anteilsklasse	USD	
Index Ticker	SPDQFAUN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,35 %	

*Ausschüttungspolitik: „Acc“ = Thesaurierende Anteile; „Dist“ = Ausschüttende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von Aktienwerten aus dem Large- und Mid-Cap-Segment in „Industrielländern“ (gemäß Definition des Indexanbieters) weltweit („Industrielländer“).

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung von Unternehmen in Industrieländern, die im Vergleich zur Gesamtheit der Unternehmen im S&P Developed LargeMidCap Index (der „**übergeordnete Index**“) Merkmale höherer Qualität aufweisen. Um als Unternehmen mit Merkmalen höherer Qualität in Betracht zu kommen, müssen Wertpapiere im übergeordneten Index zunächst das Kriterium eines über mehrere Jahre in Folge positiven freien Cashflows („**FCF**“) erfüllen. Dann werden aus den verbleibenden Wertpapieren die 100 Wertpapiere mit dem höchsten „Qualitäts-Score“ (auf Basis des 5-Jahres-Durchschnitts der FCF-Marge und des 5-Jahres-Durchschnitts der FCF-Rendite auf das investierte Kapital (FCF-ROIC), wie nachstehend beschrieben) als Indexkomponenten ausgewählt.

Als erster Schritt bei der Berechnung des „Qualitäts-Score“ werden zum Referenztag der Indexneugewichtung für jedes Wertpapier im Indexuniversum die beiden nachstehenden fundamentalen Kennzahlen berechnet. Diese werden wie folgt definiert:

- $\text{FCF-Marge} = \text{FCF} / \text{Umsatz}$
- $\text{Rendite auf das investierte Kapital („FCF-ROIC“)} = \frac{\text{FCF}}{(\text{Gesamtverschuldung} + \text{Gesamteigenkapital})}$

Hierbei ist:

- $\text{FCF} = \text{Nettokapitalfluss aus laufender Geschäftstätigkeit} - \text{Investitionsausgaben}$.

Im zweiten Schritt wird der 5-Jahres-Durchschnitt für die FCF-Marge und den FCF-ROIC berechnet. Fehlt ein Wert, so wird für die Berechnung des 5-Jahres-Durchschnitts der einfache Durchschnitt der übrigen Werte herangezogen.

Die Indexkomponenten werden durch Multiplikation der am Streubesitz orientierten Marktkapitalisierung mit dem Qualitäts-Score gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen. Weitere Details zum Qualitäts-Score entnehmen Sie bitte der Indexmethodik.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten,

richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale

Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der

Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine geringe Zahl von Aktien, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die diese geringe Zahl von Aktien betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine geringe Zahl von Aktien, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „**Derivate**“ unter „**Zugelassene Anlagen**“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechende negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „**Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit**“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrieländern suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken einschließlich der erwarteten hohen Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P Developed Quality Aristocrats UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „**Erstausgabezeitraum**“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 20 in der Währung der jeweiligen Anteilkasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

DER FONDS WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC, DEREN KONZERNGESELLSCHAFTEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER BEWORBEN. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN GESELLSCHAFTERN DES FONDS ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM FONDS IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P DEVELOPED QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. S&P ERTEILT DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) LIZENZEN FÜR BESTIMMTE MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE FÜR DEN S&P DEVELOPED QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG VON STATE STREET ODER DES FONDS FESTGELEGT, ZUSAMMENGESETZT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P DEVELOPED QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P DEVELOPED QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DER GESELLSCHAFTER BZW. ANLEGER DES FONDS ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES FONDS UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES FONDS ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES FONDS ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRÉCHNUNG DER ANTEILE DES FONDS IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES FONDS. S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P DEVELOPED QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P DEVELOPED QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN GESELLSCHAFTERN ODER ANTEILINHABERN DES FONDS ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P DEVELOPED QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P DEVELOPED QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P DEVELOPED QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNENTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (UND INSBESONDERE FÜR ENTGANGENE GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P DEVELOPED QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von SPDJI:

S&P Developed Quality FCF Aristocrats Index

Zum Datum dieses Nachtrags ist SPDJI Limited im ESMA-Register (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als Administrator gemäß Artikel 33 der Benchmark-Verordnung eingetragen.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

Nachtrag Nr. 69

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Trust Company und State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar und Juli), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung: 15:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen gegen Sachwerte: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen gegen Barzahlung und Sachwerte: 14:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	Bloomberg USD Corporate bonds 1-5 years Index (I06728US / LDC5TRUU)
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Monatlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Schlussgeldkurse.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert	
Name	State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond CHF Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF	
Währungsgesich- erter Index	k. A.		Bloomberg USD Corporate bonds 1-5 years Index (EUR abgesichert)		Bloomberg USD Corporate bonds 1-5 years Index (GBP abgesichert)		Bloomberg USD Corporate bonds 1-5 years Index (CHF abgesichert)	
Index Ticker	I06728US/ LDC5TRUU		H06728EU		H06728GB		H06728CH	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,08 %		Bis zu 0,13 %		Bis zu 0,13 %		Bis zu 0,13 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung des Marktes für kurz- und mittelfristige, festverzinsliche, auf US-Dollar lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index soll den Markt für auf USD lautende festverzinsliche Unternehmensanleihen mit Investment Grade abbilden. Auf der Grundlage des Bloomberg US Corporate Index (der „US Corporate Index“) wählt der Index Wertpapiere aus dem US Corporate Index aus, deren Restlaufzeit zwischen einem und unter fünf Jahren liegt, ungeachtet von Optionen wie Verkauf, Kauf oder Umwandlung.

Der Index investiert in Wertpapiere, bei denen es sich (wie von der Indexmethodik festgelegt) um festverzinsliche, steuerpflichtige Unternehmensanleihen mit Investment Grade und einer Laufzeit von ein bis fünf Jahren handelt. Er umfasst auf USD lautende Wertpapiere, die von US- und Nicht-US-Emittenten aus den Sektoren Industrie, Versorgung und Finanzen begeben wurden.

Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Es werden abgesicherte Anteilklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürfen die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („währungsgesicherter Index“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter investieren in den Fonds unter Anwendung der Strategie stratifizierter Stichproben, wie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ im Prospekt näher beschrieben, überwiegend in die Indexkomponenten, stets unter Einhaltung der im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Anleihepapiere, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio

des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Zugelassene Anlagen

Anleihen: Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, kann es sich um Staatsanleihen und Anleihen staatlicher Stellen sowie Unternehmensanleihen handeln.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten**“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet.

Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 70 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt. Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der

Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Durations-/Zinsänderungsrisiko: Zinsänderungen wirken sich voraussichtlich auf den Wert von Anleihen und anderen Schuldtiteln aus. Steigende Zinsen führen in aller Regel zu einem Rückgang des Werts von Anleihen, während sinkende Zinsen generell einen Wertzuwachs der Anleihen zufolge haben. Anlagen mit längerer Laufzeit und Duration reagieren stärker auf Zinsänderungen. Daher könnte eine Zinsänderung wesentliche und unmittelbare Negativeffekte auf den Wert der Fondsanlagen haben.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Währung, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten in dieser Währung betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Währung, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Schuldtitel - Kreditrisiko: Der Wert eines Schuldtitels kann beeinträchtigt werden durch die Fähigkeit oder vermeintliche Fähigkeit des Emittenten, Zahlungen pünktlich zu leisten. Die Fähigkeit eines Emittenten, seinen Verpflichtungen im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Wertpapieren nachzukommen, kann erheblich abnehmen. Das Rating, das für eine bestimmte Anlage vergeben wurde, spiegelt nicht unbedingt die aktuelle finanzielle Lage des Emittenten wider und beinhaltet keine Beurteilung der Volatilität oder Liquidität einer Anlage. Selbst Wertpapiere mit Investment Grade können Kreditschwierigkeiten unterliegen, die zum Verlust des gesamten oder eines Teils des investierten Betrags führen. Verliert ein Wertpapier, das von einem Fonds gehalten wird, sein Rating oder erfährt eine Herabstufung seines Ratings, kann der Fonds das Wertpapier nach dem Ermessen des Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter dennoch weiter halten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Die Entscheidung des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters, ob ein Engagement in einem bestimmten Wertpapier eingegangen werden soll oder nicht, wird in erster Linie durch die Komponenten des Index bestimmt, den der Fonds abbildet. Aus diesem Grund werden Nachhaltigkeitsrisiken bei Anlageentscheidungen nicht berücksichtigt. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung des Marktes für kurz und mittelfristig laufende, auf US-Dollar lautende Unternehmensanleihen mit Investment Grade suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete geringe bis mittlere Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter

angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 10 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder von den Unteranlageverwaltern festgelegten und dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilten Beträgen entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

BLOOMBERG® und Bloomberg USD Corporate Bonds 1-5 Years Index sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und ihren Konzerngesellschaften, einschließlich der Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Administrator des Index, (zusammen „Bloomberg“), und wurden von State Street für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF wird von Bloomberg nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Bloomberg gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Erklärung oder Zusicherung gegenüber den Eigentümern oder Kontrahenten des State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF oder gegenüber anderen Personen hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder in dem State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF im Besonderen ab. Die einzige Beziehung zwischen Bloomberg und State Street besteht in der Lizenzierung bestimmter Marken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken sowie des Bloomberg USD Corporate Bonds 1-5 Years Index, der von BISL ohne Berücksichtigung von State Street oder dem State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Bloomberg unterliegt keiner Verpflichtung, die Belange von State Street oder den Eigentümern des State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Bloomberg USD Corporate Bonds 1-5 Years Index zu berücksichtigen. Bloomberg ist nicht verantwortlich für die Festlegung des Ausgabezeitpunkts, der Ausgabepreise oder der Eigenschaften des auszugebenden State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETFF und ist daran auch nicht beteiligt. Bloomberg übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung im Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF, insbesondere nicht gegenüber den Anlegern des State Street SPDR Bloomberg 1-5 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF.

BLOOMBERG ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES BLOOMBERG USD CORPORATE BONDS 1-5 YEARS INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN UND HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. BLOOMBERG GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG HINSICHTLICH DER ERGEBNISSE AB, DIE STATE STREET, DIE EIGENTÜMER DES STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-5 YEAR U.S. CORPORATE BOND UCITS ETF ODER EINE ANDERE NATÜRLICHE ODER JURISTISCHE PERSON DURCH DIE VERWENDUNG DES BLOOMBERG USD CORPORATE BONDS 1-5 YEARS INDEX ODER DAMIT VERBUNDENER DATEN ERZIELEN KÖNNEN. BLOOMBERG ÜBERNIMMT IN BEZUG AUF DEN BLOOMBERG USD CORPORATE BONDS 1-5 YEARS INDEX ODER DIE DAMIT VERBUNDENEN DATEN WEDER

AUSDRÜCKLICH NOCH STILLSCHWEIGEND IRGEND EINE GEWÄHR UND LEHNT JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG AB. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN ÜBERNEHMEN BLOOMBERG, SEINE LIZENZGEBER UND SEINE BZW. DEREN JEWEILIGE MITARBEITER, AUFTRAGNEHMER, VERTRETER, ZULIEFERER UND VERTRIEBSSTELLEN, SOWEIT GESETZLICH ZULÄSSIG, KEINERLEI HAFTUNG ODER VERANTWORTUNG FÜR RECHTSVERLETZUNGEN ODER SCHÄDEN – OB ES SICH NUN UM UNMITTELBARE, MITTELBARE, FOLGESCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ ODER SONSTIGE SCHÄDEN HANDELT – DIE IN VERBINDUNG MIT DEM STATE STREET SPDR BLOOMBERG 1-5 YEAR U.S. CORPORATE BOND UCITS ETF ODER DEM BLOOMBERG USD CORPORATE BONDS 1-5 YEARS INDEX ODER DAMIT VERBUNDENEN DATEN ODER WERTEN ENTSTEHEN, UNABHÄNGIG DAVON, OB SIE AUF FAHRLÄSSIGE ODER AUF ANDERE WEISE VERURSACHT WURDEN, AUCH WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von BISL:

Bloomberg USD Corporate bonds 1-5 years Index.

Zum Datum dieses Nachtrags ist BISL, eine Verwaltungsstelle mit Sitz im Vereinigten Königreich, nicht länger im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. Die Übergangszeit für Benchmarks aus einem Drittstaat im Sinne der Benchmark-Verordnung läuft bis zum 31. Dezember 2025. Die von der EU beaufsichtigten Unternehmen dürfen während dieses Zeitraums weiterhin Benchmarks aus einem Drittstaat wie den Bloomberg USD Corporate Bonds 1-5 Years Index verwenden.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap Leaders UCITS ETF

Nachtrag Nr. 70

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap Leaders UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap Leaders UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Trust Company.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate März, Juni, September und Dezember jedes Jahr), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem alleinigen Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel 8-Fonds, vom Index einbezogenes Nachhaltigkeitsrisiko

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Für Zeichnungen und Rücknahmen nicht abgesicherter Anteilsklassen: 16:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag.
	Für Zeichnungen und Rücknahmen abgesicherter Anteilsklassen: 14.30 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag.
	Für alle Zeichnungen und Rücknahmen am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am ersten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P MidCap 400 Scored & Screened Leaders Index (SPMESLUN).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Jährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-ss-leaders-indices.pdf https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt

Informationsklassifizierung: Allgemeines

Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap Leaders UCITS ETF		State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap Leaders EUR Hdg UCITS ETF		State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap Leaders GBP Hdg UCITS ETF		State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap Leaders CHF Hdg UCITS ETF	
Ausschüttungs-politik*	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD		EUR		GBP		CHF	
Währungsgesic herter Index	k. A.		S&P MidCap 400 Scored & Screened Leaders EUR Dynamic Hedged Index		S&P MidCap 400 Scored & Screened Leaders GBP Dynamic Hedged Index		S&P MidCap 400 Scored & Screened Leaders CHF Dynamic Hedged Index	
Index Ticker	SPMESLUN		SP4LEDEN		SP4LEDGN		SP4LEDCN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,30 %		Bis zu 0,35 %					

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von Mid-Cap-Werten am US-amerikanischen Aktienmarkt.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung der 400 Unternehmen des US-Aktienmarkts mit einer mittleren Marktkapitalisierung, bekannt als S&P MidCap 400 Index (der „**Standardindex**“), wobei Unternehmen aufgrund bestimmter ESG-Merkmale, wie unten beschrieben, ausgeschlossen werden.

Der Index schließt Unternehmen aus dem Standardindex aus, die nach Feststellung des Indexanbieters und wie in der Indexmethodik dargelegt (die „**Ausschlüsse**“) an bestimmten umstrittenen Geschäftsaktivitäten beteiligt sind (u. a. in den Bereichen kontroverse Waffen, Kleinwaffen, Militärverträge, Kohle, Kraftwerkskohle, Ölsande, Schieferöl und -gas, arktische Bohrungen, Kernenergie, Tabak und Alkohol). Anschließend wählt der Index die besten 50 % der streubesitzbereinigten Marktkapitalisierung jeder Branchengruppe des Global Industry Classification Standard (**GICS**) innerhalb des Standardindex aus (abzüglich der Ausschlüsse), und zwar auf Grundlage des S&P Global ESG Score für jedes Unternehmens.

Der S&P Global ESG Score misst die Performance eines Unternehmens hinsichtlich wesentlicher ESG-Risiken, -Chancen und -Auswirkungen sowie deren Management. Die Bewertung basiert dabei auf einer Kombination aus Unternehmensangaben, den Analysen von Medien und Stakeholders, Modellansätzen und einem tiefgreifenden Engagement in Unternehmen. Weitere Informationen zu den S&P Global ESG-Scores finden Sie in der Methodik zu den S&P Global ESG-Scores:

https://portal.s1.spglobal.com/survey/documents/spglobal_esg_scores_methodology.pdf

Zu den vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen gehören: i) die Reduzierung der Nutzung von nicht erneuerbaren natürlichen Ressourcen, ii) die Förderung von Gesundheit und Wohlergehen, iii) die Unterstützung von Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung. Die Definition einer „Beteiligung“ in Bezug auf die einzelnen Tätigkeiten kann auf der Erwirtschaftung oder Ableitung von Umsätzen aus der Tätigkeit beruhen, die einen prozentualen Umsatzanteil oder eine festgelegte Gesamtumsatzschwelle übersteigen, oder auf einem Engagement in der Tätigkeit, ungeachtet der Höhe der vereinnahmten Umsätze, je nach Indexmethode. Weitere Einzelheiten entnehmen Sie bitte dem SFDR-Anhang zu diesem Nachtrag.

Die Übernahme dieser Filter im Index entspricht den vom Fonds durch das Anstreben der Indexnachbildung beworbenen ökologischen und sozialen Faktoren. Die Anwendung dieser Maßstäbe wird in den Unterabschnitten „**ESG-Screening**“ und „**Best-in-Class-ESG-Anlagen**“ des Abschnitts „**ESG-Anlagen**“ des Prospekts näher beschrieben. Unternehmen, die vom Indexanbieter als konform mit den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen eingestuft werden, gelten als Unternehmen mit guter Unternehmensführung.

Die wichtigsten methodischen Grenzen werden im Unterabschnitt „**Screening-Risiken**“ des Abschnitts „**Anlagerisiken**“ dieses Nachtrags beschrieben. Der Index misst die Wertentwicklung der Aktienwerte im Standardindex, wobei bestimmte Unternehmen aufgrund ihrer ESG-Merkmale ausgeschlossen werden, wie oben und im Anhang beschrieben. Mindestens 90 % der Vermögenswerte des Fonds werden in Wertpapiere investiert, die im Index enthalten sind. Nach der Anwendung des Ausschlussverfahrens auf das Universum des Standardindex verringert sich das Indexuniversum um mindestens 20 %.

Das Portfolio des Fonds setzt sich überwiegend aus Wertpapieren zusammen, die den oben und in der Indexmethodik beschriebenen ESG-Standards entsprechen (die sicherstellen, dass keine Wertpapiere im Portfolio enthalten sind, deren Aktivitäten dieses Ziel erheblich beeinträchtigen würden).

Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Grenzen erlauben dem Fonds, Positionen bis maximal 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds in vom selben Emittenten ausgegebenen einzelnen Indexkomponenten zu halten.

Es werden abgesicherte Anteilsklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilsklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index („**währungsgesicherter Index**“) genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher

beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. In diesem Fall kann die Bewertung der Nachhaltigkeitsmerkmale für diese ausgewählten Wertpapiere nicht garantiert werden. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Ab dem Datum dieses Nachtrags berücksichtigen der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf der Fondsebene, um durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachte negative externe Effekte möglichst zu reduzieren.

Dieser Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 SFDR. Weitere Informationen über die ökologischen und sozialen Merkmale sind dem diesem Nachtrags beigefügten Anhang zu entnehmen.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilsklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilsklasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Taxonomie-Verordnung: Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Fonds ist nicht verpflichtet, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in taxonomiekonforme Anlagen zu investieren.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Derzeit beteiligt sich der Fonds nicht an einem Wertpapierleihprogramm, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt. **Sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung dieser Politik beschließen, werden die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert.**

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Screening-Risiken: Es besteht ein Risiko von Fehlern seitens des Indexanbieters, etwa eine falsche Beurteilung der in der Anlagepolitik beschriebenen Screening-Kriterien und/oder die Aufnahme der falschen/der Ausschluss der richtigen Komponenten im Screening-Prozess. ESG-Scoring und -Screening unterliegen inhärenten methodischen Grenzen. Eine Beurteilung von ESG-Kriterien durch einen Index basiert auf den von Dritten bereitgestellten Daten. Diese Beurteilungen sind von Informationen und Daten abhängig, die unvollständig, unrichtig oder nicht verfügbar sein können, was zu einer falschen Beurteilung der ESG-Performance eines Emittenten führen kann. Insbesondere können Unstimmigkeiten, Ungenauigkeiten oder mangelnde Verfügbarkeit erforderlicher ESG-Daten auftreten, insbesondere, wenn diese von externen Datenlieferanten herausgegeben werden. Diese Grenzen können insbesondere Probleme umfassen im Zusammenhang mit:

- fehlenden oder unvollständigen Daten von Unternehmen (beispielsweise in Bezug auf deren Fähigkeit, ihre Nachhaltigkeitsrisiken zu managen), die als Eingabedaten für ein Scoring-Modell herangezogen wurden;
- die Quantität und die Qualität von zu verarbeitenden ESG-Daten; und
- die Ermittlung relevanter Faktoren für die ESG-Analyse.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Region, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten aus dieser Region betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die eine Region, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich

von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilsklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilsklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken seitens des Index gewährleistet nicht die Minderung eines oder aller Nachhaltigkeitsrisiken. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko: Die SFDR erlegt den Teilnehmern an den Finanzmärkten neue Offenlegungspflichten auf. Zum Datum dieses Nachtrags wurden die technischen Regulierungsstandards zur Umsetzung (Stufe 2) für die SFDR von der Europäischen Kommission verabschiedet. Sie sind seit dem 1. Januar 2023 in Kraft, doch sind einige der von der SFDR eingeführten Konzepte derzeit nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Der Fonds wurde in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Nachtrag und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Informationen und Klassifizierungen gemäß Artikel 8 Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung US-amerikanischer Aktienmärkte suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete hohe Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und

Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel oder frei verfügbarer Wertpapiere als Sachwerte bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilsklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap Leaders UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „**Erstausgabezeitraum**“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 10 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

SFDR-Anhang.

ANHANG II

Vorlage – Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: State Street
SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap Leaders
UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung: 984500EEEF4A449C5593

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

● ●

□

Ja

Ja

☒

Nein

☐ Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: %

☒ Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 15 % an nachhaltigen Investitionen

- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

- ☒ mit einem sozialen Ziel

☐ Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: %

☐ Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Der Fonds bewirbt ökologische Merkmale im Zusammenhang mit der Reduzierung der Nutzung nicht erneuerbarer natürlicher Ressourcen, indem er Unternehmen ausschließt, die z. B. in den Bereichen Kraftwerkskohle, Ölsand, Schieferöl und -gas, arktische Bohrungen und Kernenergie tätig sind, jeweils in Übereinstimmung mit dem S&P MidCap 400 Scored & Screened Leaders Index (der „Index“).

Außerdem werden mit dem Fonds soziale Merkmale beworben im Zusammenhang mit:

(i) einer besseren Gesundheit und einem besseren Wohlbefinden, indem Direktinvestitionen in Unternehmen ausgeschlossen werden, die an der Herstellung und dem Vertrieb von Tabakprodukten beteiligt sind; und

(ii) der Unterstützung von Menschen- und Arbeitsrechten, dem Umweltschutz und der Korruptionsbekämpfung, indem Unternehmen ausgeschlossen werden, die die Grundsätze des UN Global Compact (die „UNGC“) nicht einhalten.

Die Definition einer „Beteiligung“ in Bezug auf die einzelnen Tätigkeiten beruht auf der Erwirtschaftung oder Ableitung von Umsätzen aus der Tätigkeit die einen prozentualen Umsatzanteil oder eine festgelegte Gesamtumsatzschwelle übersteigt, oder auf einem Engagement in der Tätigkeit, ungeachtet der Höhe der vereinnahmten Umsätze. Gemäß der Indexmethode kann sich die Tätigkeit auf die Produktion oder den Vertrieb oder beides beziehen. Weitere Einzelheiten zu den angewandten Ausschlüssen zur Bewertung ökologischer und/oder sozialer Merkmale sind in der Indexmethode angegeben.

Mit dem Fonds werden die ökologischen und sozialen Merkmale durch die Nachbildung des Index beworben. Die

Indexmethode steht mit den ökologischen und sozialen Merkmalen in Einklang, die mit dem Fonds beworben werden. Weitere Informationen zu den S&P Global ESG-Scores finden Sie unter dem folgenden Link:
https://portal.s1.spglobal.com/survey/documents/spglobal_esg_scores_methodology.pdf
Weitere Informationen dazu, wo Angaben zur Indexmethode zu finden sind, entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?“



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren werden verwendet, um die Erreichung der ESG-Kriterien des vom Fonds nachgebildeten Index zu messen:

- **Durch Geschäftsaktivitäten bedingte Ausschlüsse:** Berücksichtigt wird die Beteiligung von Unternehmen an bestimmten Aktivitäten, die als umweltschädlich und/oder sozial schädlich gelten, z. B. kontroverse Waffen, Kleinwaffen, Militärverträge, Tabak, Alkohol, Glücksspiel, Kraftwerkskohle, Ölsand, Schieferöl und -gas, arktische Bohrungen und Kernenergie. Die Definition einer „Beteiligung“ in Bezug auf die einzelnen Tätigkeiten kann auf der Erwirtschaftung oder Ableitung von Umsätzen aus der Tätigkeit beruhen, die einen prozentualen Umsatzanteil oder eine festgelegte Gesamtumsatzschwelle übersteigen, oder auf einem Engagement in der Tätigkeit, ungeachtet der Höhe der vereinnahmten Umsätze. Gemäß der Indexmethode kann sich die Tätigkeit auf die Produktion oder den Vertrieb oder beides beziehen. Weitere Einzelheiten finden sich in der Indexmethodik.
- **Screening von Normen und Standards:** Ausschluss von Unternehmen, die die Grundsätze des UN Global Compact (die „UNGC“) nicht einhalten. Ausschlüsse basieren auf der Bewertung des Indexanbieters hinsichtlich der Auswirkungen eines Unternehmens auf seine Stakeholder sowie auf dem Ausmaß, in dem ein Unternehmen Verstöße gegen weltweit anerkannte Normen und Standards verursacht, zu ihnen beiträgt oder mit ihnen in Verbindung steht (siehe „Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?“).
- **Ausschlüsse aufgrund von ESG-Bewertungen:** Der Ausschluss der unteren 50 % der streubesitzbereinigten Marktkapitalisierung jeder Branchengruppe des Global Industry Classification Standard (GICS) innerhalb des S&P MidCap 400 Index (der „**Standardindex**“), und zwar auf Grundlage des S&P Global ESG Score für jedes Unternehmen.
- **Wichtigste nachteilige Auswirkungen:** Die Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (siehe „Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“).
- **Nachhaltige Investitionskriterien:** Die Identifizierung nachhaltiger Investitionen. Damit das Wertpapier als nachhaltige Anlage für den Fonds in Frage kommt, muss es vom Anlageverwalter anhand des Nachhaltigkeitsratings (anhand seines firmeneigenen Verfahrens zur Bewertung der Nachhaltigkeit, das „Nachhaltigkeitsrating“) als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden (siehe „Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?“).

Daher beabsichtigt der Fonds nicht, Wertpapiere zu halten, die die oben genannten maßgeblichen ESG-Kriterien nicht erfüllen.

Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen erfolgen in Unternehmen, die nach Einschätzung des Anlageverwalters in einer wirtschaftlichen Tätigkeit operieren, die entweder zu einem ökologischen (z. B. THG-Emissionen, Wassermanagement und ökologische Auswirkungen) oder sozialen (z. B. Menschenrechte und Mitarbeiterbindung, Vielfalt und Inklusion) Ziel beiträgt.

Der Anlageverwalter führt Analysen durch, um Unternehmen zu identifizieren, die zur Erreichung dieser ökologischen und/oder sozialen Ziele beitragen, indem er Daten von mehreren Anbietern von Nachhaltigkeitsdaten heranzieht, auf deren Grundlage er für jedes Wertpapier ein Nachhaltigkeitsrating erstellt.

Damit ein Wertpapier als nachhaltige Investition infrage kommt, muss das Unternehmen gemäß dem firmeneigenen Nachhaltigkeitsrating ein „Vorreiter“ oder „Outperformer“ sein. Ein „Vorreiter“ oder „Outperformer“ ist als ein Wertpapier definiert, das im besten 30. Perzentil des Nachhaltigkeitsuniversums des Anlageverwalters liegt, wie von ihm anhand des durch den firmeneigenen Prozess generierten Nachhaltigkeitsratings ermittelt.



Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nachhaltige Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden, sollten ökologisch oder sozial nachhaltige Investitionsziele nicht erheblich beeinträchtigen. In dieser Hinsicht berücksichtigt der Anlageverwalter die verbindlichen Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“), wie in Tabelle 1, Anhang 1 der Stufe 2 der SFDR zu Nachhaltigkeitsfaktoren festgelegt, d. h. durch die Einbeziehung des Wesentlichkeitsrahmens des SASB in das firmeneigene Nachhaltigkeitsrating des Anlageverwalters und die Anwendung der Ausschlüsse im Index. Durch die Anlage in Wertpapieren, die gemäß dem firmeneigenen Nachhaltigkeitsrating des Anlageverwalters als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden, und die Anwendung von Ausschlüssen im Index ist der Anlageverwalter der Ansicht, dass die nachhaltigen Investitionen des Fonds kein ökologisch oder sozial nachhaltiges Investitionsziel erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die verbindlichen PAIs werden sowohl durch die Einbeziehung des Wesentlichkeitsrahmens des SASB in das firmeneigene Nachhaltigkeitsrating des Anlageverwalters als auch durch die Anwendung der negativen und normenbasierten Filter in den Kriterien berücksichtigt, die der Anlageverwalter für ein Wertpapier entwickelt hat, um als nachhaltige Investition betrachtet zu werden. So werden Investitionen ausgeschlossen, die als ein ökologisch oder sozial nachhaltiges Investitionsziel beeinträchtigend gelten. Ein Beispiel für normbasiertes Screening ist der Ausschluss von Wertpapieren, die von Unternehmen emittiert wurden, die nach Research als gegen internationale Normen in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsrichtlinien und Antikorruption verstoßend befunden wurden. Ein Beispiel für einen negativen Filter ist der Ausschluss von Wertpapieren, die von Unternehmen emittiert wurden, die nach Research als im Bereich von kontroversen Waffen gemäß Festlegung im Übereinkommen über Streumunition tätig befunden wurden, und/oder die Ausschlüsse von Unternehmen auf der Grundlage anderer ESG-Kriterien wie etwa die ESG-Ratingschwellen.

Unternehmen, die im Rahmen des firmeneigenen Nachhaltigkeitsratings des Anlageverwalters, der auf dem Wesentlichkeitsrahmen des SASB basiert, als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden und die nicht durch die negativen und normenbasierten Filter ausgeschlossen werden, gelten als nachhaltige Investitionen und stellen daher keine erhebliche Beeinträchtigung eines ökologisch oder sozial nachhaltigen Investitionsziels dar. Die vorab festgelegten negativen und normenbasierten Filter werden eingesetzt, damit Unternehmen, die als nicht konform mit den Grundsätzen des UNCG (in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsnormen, Korruptionsbekämpfung) eingestuft werden, sowie ebenfalls Unternehmen, die mit schwerwiegenden ESG-Kontroversen, umstrittenen Waffen, zivilen Schusswaffen, Kraftwerkskohle, Öl- und Gasexploration in der Arktis sowie Ölsandgewinnung und Tabak in Verbindung gebracht werden, nicht als nachhaltige Investitionen betrachtet werden.

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Eine nachhaltige Investition, wie vom Anlageverwalter festgelegt, schließt keine Unternehmen ein, die nach Auffassung des Anlageverwalters gegen die Grundsätze des UNCG verstoßen. Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte werden bei der Bewertung der Grundsätze des UNCG berücksichtigt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

✓ **Ja,**

Der Fonds strebt eine Reduzierung der durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachten negativen externen Effekte an. Er berücksichtigt in diesem Zusammenhang die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Adverse Impacts, „PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er normbasierte ESG-Filter innerhalb des Index anwendet. Der Fonds berücksichtigt insbesondere:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze
- Engagement in umstrittenen Waffen

Weitere Informationen zu den PAI finden Sie in den regelmäßigen Fondsberichten.

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Aktienperformance der 400 Mid-Cap-Unternehmen des US-Aktienmarkts nach Marktkapitalisierung, bekannt als S&P MidCap 400 Index (der „**Standardindex**“). Dabei werden Unternehmen aufgrund bestimmter ESG-Merkmale wie ihrer Beteiligung an bestimmten umstrittenen Geschäftsaktivitäten (u. a. kontroverse Waffen, Kleinwaffen, Militärverträgen, Kohle, Kraftwerkskohle, Ölsand, Schieferöl und -gas, arktische Bohrungen, Atomkraft, Tabak, Alkohol) ausgeschlossen, wie vom Indexanbieter in der Indexmethodik dargelegt (die „**Ausschlüsse**“). Anschließend wählt der Index die besten 50 % der streubesitzbereinigten Marktkapitalisierung jeder Branchengruppe des Global Industry Classification Standard (GICS) innerhalb des Standardindex aus (abzüglich der Ausschlüsse), und zwar auf Grundlage des S&P Global ESG Score für jedes Unternehmens.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index nachzubilden. Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet.

Zu den verbindlichen Elementen der Anlagestrategie des Index gehören:

- Der Ausschluss von Unternehmen aufgrund ihrer Beteiligung an bestimmten Aktivitäten, die als umweltschädlich und/oder sozial schädlich gelten, z. B. kontroverse Waffen, Kleinwaffen, Militärverträge, Tabak, Alkohol, Glücksspiel, Kraftwerkskohle, Ölsand, Schieferöl und -gas, arktische Bohrungen und Kernenergie.
- Der Ausschluss von Unternehmen aufgrund ihrer Beteiligung an der Herstellung und dem Vertrieb von Tabakprodukten.
- Der Ausschluss von Unternehmen, die die Grundsätze des UN Global Compact (die

Die **Anlagestrategie** dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

„UNGC“) für Menschen- und Arbeitsrechte, die Umwelt und die Korruptionsbekämpfung nicht einhalten.

- Die Aufnahme der oberen 50 % der streubesitzbereinigten Marktkapitalisierung jeder GICS-Branchengruppe in den Standardindex (abzüglich Ausschlüsse) unter Verwendung eines S&P Global ESG Scores als definierendes Merkmal. Der S&P Global ESG Score misst die Performance eines Unternehmens hinsichtlich wesentlicher ESG-Risiken, -Chancen und -Auswirkungen sowie deren Management. Die Bewertung basiert dabei auf einer Kombination aus Unternehmensangaben, den Analysen von Medien und Stakeholders, Modellansätzen und einem tiefgreifenden Engagement in Unternehmen. Weitere Informationen zum S&P Global ESG Score finden Sie oben im Abschnitt „Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?“.

Die Verfahrensweisen einer **guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

Der Fonds schließt Anlagen in Emittenten aus, wie in der Anlagestrategie und den verbindlichen Anforderungen vorstehend dargelegt, sieht jedoch keinen festgelegten Mindestsatz vor, um den Umfang der Anlagen zu reduzieren.

Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?

Der Fonds praktiziert eine gute Unternehmensführung, indem er den Index nachbildet, der Unternehmen ausschließt, die weltweit anerkannte Normen und Standards in Bezug auf Unternehmensführung, wie beispielsweise die Zusammensetzung des Verwaltungsrats, die Vergütung von Leitungs- und Führungskräften, Aktionärsrechte und Unternehmensethik, nicht erfüllen. Der Indexanbieter bewertet den Einfluss jedes Unternehmens auf seine Stakeholder und inwieweit ein Unternehmen Verstöße gegen weltweit anerkannte Normen und Standards verursacht, zu ihnen beiträgt oder mit ihnen in Verbindung steht. Die Bewertungen des Indexanbieters basieren auf den UNGC-Grundsätzen. Sie berücksichtigen aber auch Informationen zu verwandten Standards, darunter die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte sowie die ihnen zugrunde liegenden Konventionen. Unternehmen, die vom Indexanbieter als nicht konform eingestuft werden, sind für eine Aufnahme in den Index nicht zugelassen.

Unternehmen, die nach Einschätzung des Anlageverwalters nicht gegen die UNGC-Grundsätzen verstoßen, gelten als eine gute Unternehmensführung aufweisend. Die vom Indexanbieter gemäß der Indexmethodik verwendeten Kriterien für die Bewertung der Praktiken einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, stehen im Einklang mit dem Ansatz des Anlageverwalters, demzufolge Unternehmen ausgeschlossen werden, die nach Ansicht des Indexanbieters gegen die Grundsätze des UN Global Compact verstoßen.

Informationen zu den Indexmethoden, die bei der Konstruktion des Index verwendet werden, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen sind der <https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-dji-esg-score.pdf>

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index enthalten und auf ökologische und/oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, während der Indexanbieter ESG-Ratings für alle Indexkomponenten anwendet. Es ist beabsichtigt, dass innerhalb dieses Teils des Portfolios mindestens **15 %** des Fondsvermögens in Wertpapiere investiert werden, bei denen es sich zum Zeitpunkt der in der Regel jährlichen Portfolioneugewichtung um nachhaltige Investitionen mit ökologischen und/oder sozialen Zielen handelt. Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters 10 % seines Vermögens in Form von Zahlungsmitteln oder Zahlungsmitteläquivalenten und Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden, und die in der nachstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft würden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen. Das Portfolio des Fonds setzt sich überwiegend aus Wertpapieren zusammen, die den oben und in der Indexmethode beschriebenen ESG-Standards entsprechen (wodurch sichergestellt wird, dass keine Emittenten im Portfolio enthalten sind, deren Aktivitäten dieses Ziel wesentlich beeinträchtigen würden). Der Fonds verpflichtet sich nicht ausdrücklich zu einer separaten Allokation in sozial nachhaltigen Investitionen, die sich von ökologisch nachhaltigen Investitionen unterscheiden. Dieser Ansatz spiegelt die breitere ESG-Strategie des Fonds wider, die sowohl ökologische als auch soziale Überlegungen in ihre nachhaltigen Investitionskriterien integriert.

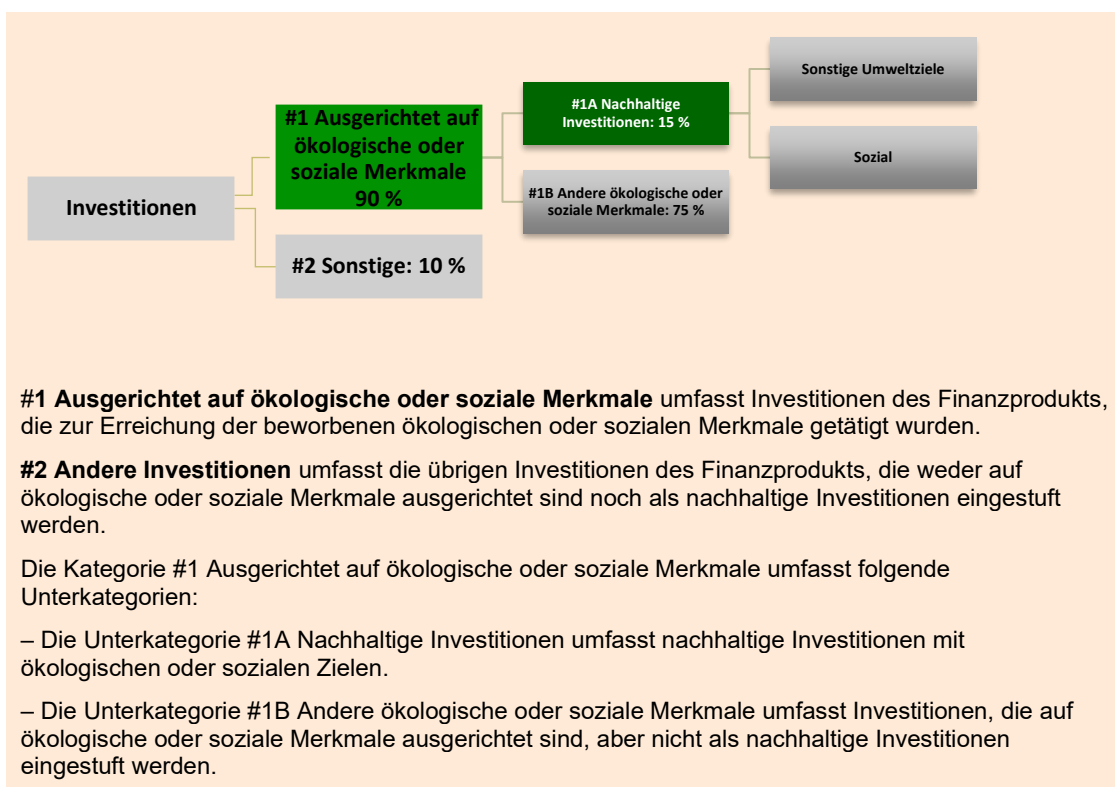
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Soweit der Fonds ausschließlich zum Zweck der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzt, werden diese nicht zur Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Daher verpflichtet sich der Fonds nicht, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in Anlagen zu investieren, die der Taxonomie-Verordnung entsprechen. Daher ist zu beachten, dass dieser Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Taxonomie-Verordnung nicht berücksichtigt. Es ist daher keine Ausrichtung des Portfolios an der Taxonomie-Verordnung geplant.

Es ist keine Ausrichtung an der Taxonomie-Verordnung beabsichtigt.

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-

und/oder Kernenergie investiert?¹



Ja:

In fossiles Gas

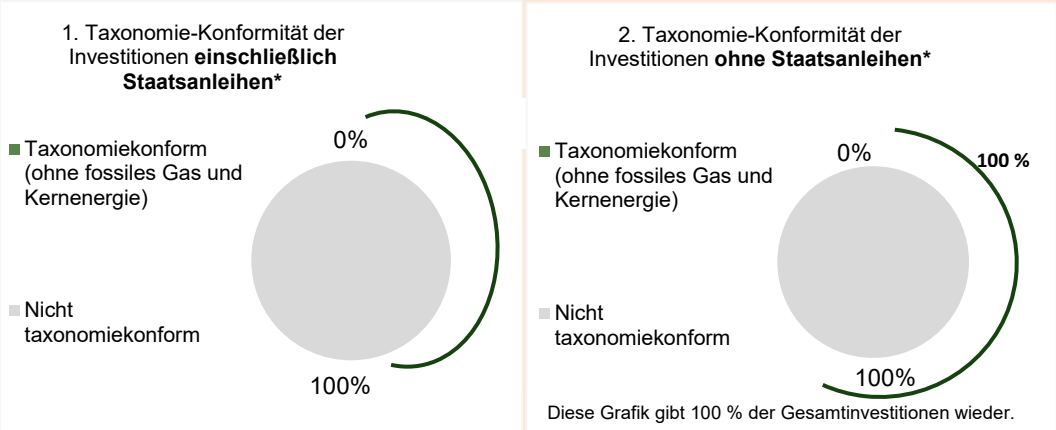


In Kernenergie



Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Da sich der Fonds nicht verpflichtet, in „ökologisch nachhaltige Investitionen“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung zu investieren, wurde der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten deshalb auch mit 0 % angesetzt.



Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Fonds beabsichtigt, mindestens 0 % seines Vermögens in nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel zu investieren, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind. Die Festlegung der Bewertung der Fondsinvestitionen, die als nachhaltig eingestuft werden, erfolgt in der Regel monatlich, wenn die ESG-Bewertungen aktualisiert werden.



Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Fonds beabsichtigt, mindestens 0 % seines Vermögens in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren. Die Festlegung der Bewertung der Fondsinvestitionen, die als nachhaltig eingestuft werden, erfolgt in der Regel monatlich, wenn die ESG-Bewertungen aktualisiert werden.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomie **nicht berücksichtigen**.

Während der Fonds sich zwar zu **15 %** an nachhaltigen Investitionen verpflichtet, besteht keine ausdrückliche Verpflichtung zu einer separaten Allokation in sozial/ökologisch nachhaltigen Investitionen, die sich von der allgemeinen **15 %-igen** Allokation des Fonds zu nachhaltigen Investitionen unterscheidet. Dieser Ansatz spiegelt die breitere ESG-Strategie des Fonds wider. Sie integriert sowohl ökologische als auch soziale Aspekte in ihre nachhaltigen Investitionskriterien, ohne jedoch die Allokation zwischen ökologischen und sozialen Zielen spezifisch aufzuschlüsseln oder sie an der EU-Taxonomie auszurichten.



Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen Teil seines Vermögens in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten sowie in Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden und die in der vorstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft werden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.



Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Der Fonds bildet die Wertentwicklung des S&P MidCap 400 Scored & Screened Leaders Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nach und strebt danach, so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?

Die Indexmethodik sieht eine laufende Überprüfung und jährliche Neugewichtung vor, bei der der Standardindex auf die oben dargelegten ESG-Ausschlusskriterien überprüft wird. Die Anwendung dieser Filter oder „Screens“ innerhalb des Index entspricht den ökologischen und sozialen Faktoren, die der Fonds bewirbt, indem er danach strebt, den Index wie oben beschriebenen nachzubilden.

Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?

Der Fonds wird jährlich in Übereinstimmung mit der Häufigkeit der Neugewichtung des Index ebenfalls neu gewichtet.

Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?

Der bestimmte Index implementiert Ausschlüsse und Änderungen der Indexgewichtungen gegenüber dem relevanten breiten Marktindex, die von den ESG-Merkmalen der Unternehmen abhängen, wobei sowohl ESG-Ratings als auch die Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten berücksichtigt werden, wie vom Indexanbieter S&P Dow Jones Indices LLC („SPDJ“) festgelegt. Informationen zur Indexmethodik, die bei der Konstruktion des Index verwendet wird, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von SPDJI.

Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?

<https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-ss-leaders-indices.pdf>

Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:



[Anlagen in SPDR Exchange Traded Funds \(ETFs\) \(ssga.com\)](https://www.ssga.com)

State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap Leaders UCITS ETF

DER STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP LEADERS UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP LEADERS UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP LEADERS UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P MIDCAP 400 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P MIDCAP 400 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET CORPORATION ODER DES STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP LEADERS UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESETZT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P MIDCAP 400 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P MIDCAP 400 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP LEADERS UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP LEADERS UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP LEADERS UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP LEADERS UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP LEADERS UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP LEADERS UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P MIDCAP 400 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P MIDCAP 400 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN GESELLSCHAFTERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P 400 U.S. MID CAP LEADERS UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P MIDCAP 400 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P MIDCAP 400 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P MIDCAP 400 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (UND INSBESONDERE FÜR ENTGANGENE GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P MIDCAP 400 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Verordnung (EU) 2016/1011 [Benchmark-Verordnung]) die folgende Benchmark:

S&P MIDCAP 400 SCORED & SCREENED LEADERS INDEX

Zum Datum des Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register der Referenzwerte aus Drittstaaten (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als in Einklang mit Artikel 33 der Benchmark-Verordnung anerkannter Administrator eingetragen.

State Street SPDR S&P Europe Quality Aristocrats UCITS ETF

Nachtrag Nr. 71

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde.)

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street SPDR S&P Europe Quality Aristocrats UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street SPDR S&P Europe Quality Aristocrats UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID sorgfältig prüfen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	EUR
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untereinlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar, April, Juli und Oktober), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 14.30 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit). Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt am maßgeblichen Handelstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P Europe Quality FCF Aristocrats Index (SPEQFAEN).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Halbjährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seiner Wertentwicklung finden Sie unter https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-qly-fcf-aristocrats-indices.pdf https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts“ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt
Bewertungszeitpunkt	18:45 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Informationsklassifizierung: Allgemeines

Anteilstklassen

Art der Anteilsklasse	EUR nicht abgesichert	
Name	State Street SPDR S&P Europe Quality Aristocrats UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	EUR	
Index Ticker	SPEQFAEN	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,25 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von Aktienwerten aus dem Large- und Mid-Cap-Segment (Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung) in europäischen Industrieländern.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Der Index misst die Wertentwicklung von europäischen Unternehmen, die im Vergleich zur Gesamtheit der Unternehmen im S&P Europe LargeMidCap Index (der „**übergeordnete Index**“) Merkmale höherer Qualität aufweisen, wobei Unternehmen aus den Schwellenländern Europas ausgeschlossen sind. Um als Unternehmen mit Merkmalen höherer Qualität in Betracht zu kommen, müssen Wertpapiere im übergeordneten Index zunächst das Kriterium eines über mehrere Jahre in Folge positiven Cashflows („**FCF**“) erfüllen. Dann werden aus den verbleibenden Wertpapieren die 100 Wertpapiere mit dem höchsten „Qualitäts-Score“ (auf Basis des 5-Jahres-Durchschnitts der FCF-Marge und des 5-Jahres-Durchschnitts der FCF-Rendite auf das investierte Kapital (FCF-ROIC), wie nachstehend beschrieben) als Indexkomponenten ausgewählt.

Als erster Schritt bei der Berechnung des „Qualitäts-Score“ werden zum Referenztag der Indexneugewichtung für jedes Wertpapier im Indexuniversum die beiden nachstehenden fundamentalen Kennzahlen berechnet. Diese werden wie folgt definiert:

- $\text{FCF-Marge} = \text{FCF} / \text{Umsatz}$
- $\text{FCF-Rendite auf das investierte Kapital („ROIC“)} = \text{FCF} / (\text{Gesamtverschuldung} + \text{Gesamteigenkapital})$

Hierbei ist:

- $\text{FCF} = \text{Nettokapitalfluss aus laufender Geschäftstätigkeit} - \text{Investitionsausgaben}$.

Im zweiten Schritt wird der 5-Jahres-Durchschnitt für die FCF-Marge und den FCF-ROIC berechnet. Fehlt ein Wert, so wird für die Berechnung des 5-Jahres-Durchschnitts der einfache Durchschnitt der übrigen Werte herangezogen.

Die Indexkomponenten werden durch Multiplikation der am Streubesitz orientierten Marktkapitalisierung mit dem Qualitäts-Score gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen. Weitere Details zum Qualitäts-Score entnehmen Sie bitte der Indexmethodik.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist,

abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Grenzen erlauben dem Fonds, Positionen bis maximal 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds in vom selben Emittenten ausgehenden einzelnen Indexkomponenten zu halten.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („**DFI**“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom

Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Anleger sollten beachten, dass die Gesellschaft für den Fonds Wertpapierleihgeschäfte gemäß dem Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von Pensionsgeschäften/umgekehrten Pensionsgeschäften/Wertpapierleihverträgen“ im Prospekt tätigen kann, wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter dies für angemessen erachtet. Anleger sollten diesbezüglich die Risikohinweise unter der Überschrift „Risiko der Wertpapierleihe“ im Abschnitt „Risikoinformationen“ des Prospekts lesen. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierleihgeschäften wird, ausgedrückt als Prozentsatz von seinem Nettoinventarwert, 40 % nicht übersteigen. Der Umfang der Wertpapierleihgeschäfte wird durch Marktfaktoren beeinflusst und kann vorbehaltlich der zuvor genannten Obergrenze nicht genau vorhergesagt werden. Die Angaben zu Wertpapierleihen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Hinweis auf den Umfang von Wertpapierleihgeschäften. Es ist nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- oder umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Die Gesellschaft hat die State Street Bank and Trust Company, eine nach dem Recht von Massachusetts gegründete Bank, die ihren eingetragenen Sitz in One Congress Street, Boston, Massachusetts, 02114-2016, USA, hat und für die Zwecke des Wertpapierleihvertrags über ihre Niederlassung London (Registrierungsnummer BR002088 der Niederlassung in England), 20 Churchill Place, London E14 5HJ, England, handelt, als Vermittler für Wertpapierleihen gemäß einem Wertpapierleihvertrag vom 27. Oktober 2023 zwischen der Gesellschaft, der State Street Bank and Trust Company und der Verwahrstelle (ein „Wertpapierleihvertrag“) bestellt. Dieser Wertpapierleihvertrag beauftragt die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, die Wertpapierleihgeschäfte des Fonds zu verwalten, und sieht vor, dass die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, ein Honorar zu marktüblichen Sätzen zur Deckung aller Gebühren und Kosten im Zusammenhang mit der Erbringung dieser Dienstleistung erhält. Aus der Wertpapierleihe erzielte Erträge fließen nach Abzug direkter und indirekter Betriebskosten (einschließlich des an die State Street Bank and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten Honorars) an den Fonds zurück. Die vollständigen finanziellen Daten zu erzielten Erträgen und den in Bezug auf die Wertpapierleihgeschäfte für den Fonds entstandenen direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, einschließlich der an die State Street Bank International and Trust Company, Niederlassung London, gezahlten bzw. fälligen Honorare, werden im Jahresabschluss angegeben.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik der Gesellschaft beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 1 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine bestimmte Region, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die Emittenten aus dieser Region betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die einen Sektor und Markt, auf den der Fonds seine Anlagen konzentriert, betreffen oder voraussichtlich betreffen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Die Entscheidung des

Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters, ob ein Engagement in einem bestimmten Wertpapier eingegangen werden soll oder nicht, wird in erster Linie durch die Komponenten des Index bestimmt, den der Fonds abbildet. Aus diesem Grund werden Nachhaltigkeitsrisiken bei Anlageentscheidungen nicht berücksichtigt. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt **„Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“** des Prospekts lesen.

Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung von Aktien großer und mittelständischer Unternehmen aus europäischen Industrieländern suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken in Kauf zu nehmen, einschließlich der zu erwartenden hohen Volatilität des Fonds.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile der folgenden Anteilklassen des Fonds werden zum handelbaren NIW ausgegeben:

State Street SPDR S&P Europe Quality Aristocrats UCITS ETF (Acc)

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 10 in der Währung der jeweiligen Anteilklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Abgaben und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem

State Street SPDR S&P Europe Quality Aristocrats UCITS ETF

DER STATE STREET SPDR S&P EUROPE QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P EUROPE QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SPDR S&P EUROPE QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P EUROPE QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ANLAGEZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P EUROPE QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET CORPORATION ODER DES STATE STREET SPDR S&P EUROPE QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P EUROPE QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P EUROPE QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SPDR S&P EUROPE QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SPDR S&P EUROPE QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SPDR S&P EUROPE QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SPDR S&P EUROPE QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SPDR S&P EUROPE QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SPDR S&P EUROPE QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESER WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P EUROPE QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX ODER VON DARIN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P EUROPE QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SPDR S&P EUROPE QUALITY ARISTOCRATS UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P EUROPE QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P EUROPE QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P EUROPE QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNENTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (UND INSBESONDERE FÜR ENTGANGENE GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P EUROPE QUALITY FCF ARISTOCRATS INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Verordnung (EU) 2016/1011 [Benchmark-Verordnung]) die folgende Benchmark:

S&P Europe Quality FCF Aristocrats Index

Zum Datum des Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register der Referenzwerte aus Drittstaaten (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als in Einklang mit Artikel 33 der Benchmark-Verordnung anerkannter Administrator eingetragen.

State Street Saudi Arabia Enhanced Active Equity UCITS ETF

Nachtrag Nr. 72

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19 Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street Saudi Arabia Enhanced Active Equity UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street Saudi Arabia Enhanced Active Equity UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Der Fonds ist ein aktiv verwalteter Fonds.

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Eine Anlage in dem Fonds sollte keinen bedeutenden Anteil an einem Anlageportfolio darstellen und ist unter Umständen nicht für jeden Anleger geeignet.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Juni und Dezember), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Im Sinne von Artikel 6 der SFDR ist die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken für diesen Fonds nicht relevant.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jedes Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit) Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag, oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	S&P Saudi Arabia BMI 5/10/40 Capped Index (index ticker SPBSACUN).
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-pan-arab.pdf https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Letztgehandelter Kurs
Bewertungszeitpunkt	18:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilstklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street Saudi Arabia Enhanced Active Equity UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,75 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist es, eine Rendite zu erzielen, die über der Performance der saudischen Aktienmärkte liegt.

Anlagepolitik: Der Fonds wird (bezogen auf den Index) aktiv verwaltet. Die Anlagepolitik des Fonds besteht darin, den Index (oder einen anderen Index der vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegt wird und im Wesentlichen denselben Markt wie der Index abbildet) mittel- bis langfristig zu übertreffen. Wenngleich der Fonds aufgrund der sich verändernden Volatilität und Renditemerkmale der saudi-arabischen Aktienmärkte keine absolute Zielrendite und/oder Überrendite gegenüber dem Index anstrebt, wird unter normalen Marktbedingungen in der Regel von einer Rendite oberhalb des Index (nach Abzug von Gebühren und Kosten) bei einem vergleichbaren Risikoprofil ausgegangen. Es besteht die Möglichkeit, dass der Fonds den Index nicht übertrifft oder lediglich verhältnismäßig geringe Nettorenditen oberhalb des Index erzielt.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter verfolgen eine aktive Anlagestrategie, die auf einem eigenen quantitativen Multi-Faktor-Modell zur Aktienauswahl („Alpha-Modell“) des Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters basiert und zur Beurteilung der Attraktivität von Aktien eingesetzt wird. Dieses Alpha-Modell generiert Renditeprognosen für Aktien. Das Modell basiert auf einer relativen Bewertung jeder Aktie hinsichtlich der Themen Qualität, Wert und Stimmung. Darüber hinaus bewertet das Alpha-Modell die Renditeerwartungen hinsichtlich der Sektoren und beinhaltet eine dynamische Komponente, die sowohl auf titelspezifischen (Bottom-up) als auch auf makroökonomischen (Top-down) Inputs basiert. Bei der Zusammenstellung des Portfolios sind der Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter bemüht, Rendite- und Risikoerwartungen gegeneinander abzuwägen. Zu den definierten Risikoparametern gehören Beschränkungen hinsichtlich der Gewichtung von Sektoren und Wertpapieren auf absoluter Basis und im Verhältnis zum Index. Die Performance des Fonds wird gegenüber dem Index gemessen. Da der Fonds aktiv verwaltet wird und eine Outperformance gegenüber dem Index anstrebt, unterscheiden sich seine Bestände von denen des Index.

Obwohl der Fonds in der Regel in Wertpapiere investiert, die Komponenten des Index sind, können seine Positionen und Gewichtungen erheblich von denen des Index abweichen, um sein Anlageziel einer Outperformance gegenüber dem Index zu erreichen. Der Fonds kann auch nicht im Index geführte Wertpapiere mit Sitz in Saudi-Arabien halten. Weitere Angaben zu den Arten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert, entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Zugelassene Anlagen“ weiter unten. Die Gewichtung der Wertpapiere im Fonds erfolgt unabhängig vom Index, wobei der Index als Bezugspunkt für die Zusammensetzung des Portfolios herangezogen werden kann. Die Rendite des Fonds weicht in der Regel von derjenigen des Index ab und kann hinter dieser zurückbleiben.

Der Index misst die Wertentwicklung der Aktienmärkte Saudi-Arabiens. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist,

wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend aus Large-, Mid- und Small-Cap-Aktien entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen bestehen, die an anerkannten Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Large-, Mid- und Small-Cap-Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass die Fondsrendite vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Der Fonds beabsichtigt nicht, sich an einem Wertpapierleihprogramm zu beteiligen, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik des Fonds beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt

„**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Aktives Risiko: Die Anlagerendite entspricht in der Regel nicht der des Index. Anlageentscheidungen des Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters, Wertpapiere des Index unter- oder überzugewichten oder die Anlagen im Fonds gegenüber den Indexkomponenten zu variieren, einschließlich in Bezug auf bestimmte Wertpapiere oder breitere Anlagesektoren, haben Einfluss auf die Wertentwicklung des Fonds im Vergleich zum Index. Darüber hinaus wird die Wertentwicklung des Fonds im Vergleich zum Index durch Kosten des Fonds, den Bestand an liquiden Mitteln im Fonds sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen beeinflusst.

Managementrisiko: Der Fonds wird aktiv verwaltet. Die Einschätzung des Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters hinsichtlich der Attraktivität, des relativen Werts oder einer potenziellen Wertsteigerung eines bestimmten Sektors, eines Wertpapiers, eines Rohstoffs oder einer Anlagestrategie kann sich als falsch erweisen und zu Verlusten für den Fonds führen. Es kann nicht garantiert werden, dass die Anlagetechniken und -entscheidungen des Anlageverwalters zu den gewünschten Ergebnissen führen.

Modellrisiko: Der Anlageverwalter verwendet zur Renditestärkung und zum Risikomanagement quantitative Modelle. Unvollkommenheiten, Fehler oder Einschränkungen in diesen Modellen oder ihrer Programmierung könnten den Nutzen, den der Fonds aus der Verwendung der Modelle zieht, einschränken und zu falschen Ergebnissen oder zu Anlageergebnissen führen, die nicht den vom Anlageverwalter erwarteten oder erwünschten Anlageergebnissen entsprechen. Derlei Unvollkommenheiten, Fehler oder Einschränkungen werden möglicherweise nie oder erst dann entdeckt, wenn ein Fonds bereits einen Verlust erlitten (oder eine geringere Performance erzielt) hat. Ferner kann nicht garantiert werden, dass sich die Modelle unter allen Marktbedingungen wie erwartet verhalten werden.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Schwellenländerrisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht

und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe.

Risiken im Zusammenhang mit kleineren Unternehmen: Die Wertpapiere von Unternehmen mit geringer, mittlerer und kleinster Kapitalisierung reagieren mitunter volatiler und werden seltener und in kleineren Stückzahlen gehandelt als die Wertpapiere größerer Unternehmen. Solche Unternehmen verfügen unter Umständen über begrenzte Produktlinien, Märkte oder Finanzmittel, ihre Wettbewerbsstärke kann geringer sein als bei größeren Unternehmen und sie sind womöglich von wenigen Schlüsselpersonen in ihrer Belegschaft abhängig. Hinzu kommt, dass diese Unternehmen möglicherweise nur eine kurze oder gar keine Erfolgshistorie aufweisen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiko im Zusammenhang mit Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren: Die Marktkurse von Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren können steigen oder fallen, manchmal schnell und unvorhersehbar. Der Wert dieser Wertpapiere kann aus Gründen fallen, die direkt mit dem Emittenten zusammenhängen und/oder aufgrund von allgemeinen Branchen- oder Marktbedingungen, wie z. B. tatsächlichen oder wahrgenommenen widrigen Wirtschaftsbedingungen, Veränderungen im allgemeinen Ausblick für Unternehmensgewinne, Zins- oder Wechselkursänderungen oder einer allgemein negativen Anlegerstimmung. Aktienmärkte bewegen sich zyklisch. Das kann dazu führen, dass Aktienkurse über kürzere oder längere Zeiträume fallen.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Das Nachhaltigkeitsrisiko wurde nicht in den Anlageprozess des Fonds einbezogen. Da die Anlagestrategie des Fonds darauf ausgerichtet ist, durch Engagements in saudi-arabischen Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren Erträge und Kapitalzuwächse zu erzielen, werden Nachhaltigkeitsrisiken als nicht relevant erachtet. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben. Beim Eintreten eines nachhaltigkeitsbezogenen Risikoereignisses kann dieser Fonds stärker als ein entsprechender Fonds beeinträchtigt werden, der Nachhaltigkeitsrisiken einbezieht. Für weitere Informationen sollten die Anteilinhaber den Abschnitt „Indexstrategien und Einbeziehung von Nachhaltigkeit“ des Prospekts lesen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger

sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung von Large-, Mid- und Small-Cap-Aktien Saudi-Arabiens suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt **„Kauf- und Verkaufsinformationen“** des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 10 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Kosten und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

State Street Saudi Arabia Enhanced Active Equity UCITS ETF

DER STATE STREET SAUDI ARABIA ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF WIRD VON S&P DOW JONES INDICES LLC ODER DEREN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN UND/ODER DRITTLIZENZGEBERN (ZUSAMMEN „S&P“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER BEWORBEN. S&P GIBT KEINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEN ANTEILINHABERN DES STATE STREET SAUDI ARABIA ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN AB HINSICHTLICH DER ZWECKMÄSSIGKEIT EINER ANLAGE IN WERTPAPIEREN IM ALLGEMEINEN ODER IM STATE STREET SAUDI ARABIA ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF IM BESONDEREN ODER HINSICHTLICH DER FÄHIGKEIT DES S&P SAUDI ARABIA BMI 5/10/40 CAPPED INDEX, DIE MARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN UND/ODER SEIN ERKLÄRTES ZIEL ZU ERREICHEN UND/ODER DIE BASIS FÜR EINE GEEIGNETE ANLAGESTRATEGIE ZU BILDEN. DIE BEZIEHUNG VON S&P GEGENÜBER DER STATE STREET CORPORATION („STATE STREET“) IST DIE EINES LIZENZGEBERS BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DES S&P SAUDI ARABIA BMI 5/10/40 CAPPED INDEX, DER VON S&P OHNE BERÜCKSICHTIGUNG DER STATE STREET CORPORATION ODER DES STATE STREET SAUDI ARABIA ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WIRD. S&P UNTERLIEGT KEINER VERPFLICHTUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETZUNG ODER BERECHNUNG DES S&P SAUDI ARABIA BMI 5/10/40 CAPPED INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P SAUDI ARABIA BMI 5/10/40 CAPPED INDEX VERWENDET WERDEN, DIE BELANGE VON STATE STREET ODER DEN EIGENTÜMERN BZW. ANLEGERN DES STATE STREET SAUDI ARABIA ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF ZU BERÜCKSICHTIGEN. S&P IST KEIN BERATER DES STATE STREET SAUDI ARABIA ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF UND NICHT FÜR DIE FESTLEGUNG DER PREISE UND DES UMFANGS DES STATE STREET SAUDI ARABIA ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF ODER DEN ZEITPUNKT DER AUSGABE ODER DES VERKAUFS DES STATE STREET SAUDI ARABIA ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER DIE UMRECHNUNG DER ANTEILE DES STATE STREET SAUDI ARABIA ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF IN BARGELD ERFOLGT, VERANTWORTLICH ODER DARAN BETEILIGT. S&P ÜBERNIMMT KEINERLEI VERPFLICHTUNG ODER HAFTUNG IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM HANDEL DES STATE STREET SAUDI ARABIA ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF. DIE AUFNAHME EINES WERTPAPIERS IN EINEN INDEX STELLT WEDER EINE EMPFEHLUNG ZUM KAUF, VERKAUF ODER HALTEN DIESES WERTPAPIERS DAR, NOCH IST DIESE AUFNAHME ALS ANLAGEBERATUNG ANZUSEHEN.

S&P ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHR FÜR DIE RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES S&P SAUDI ARABIA BMI 5/10/40 CAPPED INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P SAUDI ARABIA BMI 5/10/40 CAPPED INDEX VERWENDET WERDEN, UND S&P HAFTET NICHT FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN DARIN. S&P

GIBT KEINERLEI AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ERKLÄRUNG, ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG HINSICHTLICH DER VON STATE STREET, DEN EIGENTÜMERN ODER ANTEILINHABERN DES STATE STREET SAUDI ARABIA ENHANCED ACTIVE EQUITY UCITS ETF ODER ANDEREN NATÜRLICHEN ODER JURISTISCHEN PERSONEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWENDUNG DES S&P SAUDI ARABIA BMI 5/10/40 CAPPED INDEX ODER VON DATEN, DIE DARIN ENTHALTEN SIND ODER FÜR DIE BERECHNUNG DES S&P SAUDI ARABIA BMI 5/10/40 CAPPED INDEX VERWENDET WERDEN, ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. HINSICHTLICH DES S&P SAUDI ARABIA BMI 5/10/40 CAPPED INDEX UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT S&P KEINE AUSDRÜCKLICHEN ODER STILLSCHWEIGENDEN ZUSICHERUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER GEWÄHRLEISTUNGEN UND SCHLIESST AUSDRÜCKLICH SÄMTLICHE GEWÄHRLEISTUNGEN, ERKLÄRUNGEN ODER ZUSICHERUNGEN FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG SOWIE JEDWEDE ANDERE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG ODER ZUSICHERUNG AUS. UNBESCHADET DER ALLGEMEINEN GÜLTIGKEIT DES VORGENANNENTEN HAFTET S&P IN KEINEM FALLE FÜR BESONDERE SCHÄDEN, STRAFE EINSCHLIESSENDEN SCHADENERSATZ, MITTELBARE ODER FOLGESCHÄDEN (UND INSBESONDERE FÜR ENTGANGENE GEWINNE), DIE DURCH DIE VERWENDUNG DES S&P SAUDI ARABIA BMI 5/10/40 CAPPED INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ENTSTEHEN, SELBST WENN AUF DIE MÖGLICHKEIT DERARTIGER SCHÄDEN HINGEWIESEN WURDE.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Verordnung (EU) 2016/1011 [Benchmark-Verordnung]) die folgende Benchmark:

S&P Saudi Arabia BMI 5/10/40 Capped Index

Zum Datum des Nachtrags ist SPDJI im ESMA-Register der Referenzwerte aus Drittstaaten (gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung) als in Einklang mit Artikel 33 der Benchmark-Verordnung anerkannter Administrator eingetragen.

State Street Global Dividend Spotlight Active Equity UCITS ETF

Nachtrag Nr. 73

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street Global Dividend Spotlight Active Equity UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street Global Dividend Spotlight Active Equity UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Der Fonds ist ein aktiv verwalteter Fonds.

Da der Fonds wesentlich in Schwellenmärkten engagiert sein kann, sollte eine Anlage im Fonds keinen bedeutenden Anteil an einem Anlageportfolio darstellen und ist unter Umständen nicht für jeden Anleger geeignet.

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Januar, April, Juli und Oktober), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel-8-Fonds, bezieht Nachhaltigkeitsrisiken ein.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit) Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	Für Zeichnungen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag, für Rücknahmen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	MSCI World High Dividend Yield Index (Ticker: M1WDHVD)
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: http://www.msci.com/products/indices/licensing/constituents.html

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street Global Dividend Spotlight Active Equity UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,45 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds besteht darin, langfristigen Kapitalzuwachs herbeizuführen, indem in globale Aktienwerte investiert wird.

Anlagepolitik: Der Fonds wird aktiv verwaltet. Die Anlagepolitik des Fonds besteht darin, vorrangig in globale Aktien mit einer hohen Dividendenrendite zu investieren, wie im Abschnitt „Zugelassene Anlagen“ näher beschrieben. Der Anlageverwalter wird eine firmeneigene aktive Anlagestrategie verfolgen, bei der ein fundamental orientierter Bottom-up-Researchprozess zum Einsatz kommt, der Aktien ermittelt, die nach Einschätzung des Anlageverwalters mit einem Abschlag auf den geschätzten inneren Wert des Unternehmens gehandelt werden. Auf Basis der sich daraus ergebenden Anlagegelegenheiten wird ein ausgewogenes globales Portfolio aus 30 bis 40 Wertpapieren zusammengestellt, die nach Überzeugung des Anlageverwalters das Potenzial haben, Überrenditen zu generieren. Bei der Auswahl der Anlagen wird der Anlageverwalter weder einen bestimmten geografischen noch einen sektoralen Schwerpunkt setzen.

Die Performance des Fonds wird gegenüber dem Index gemessen. Da der Fonds aktiv verwaltet wird und eine Outperformance gegenüber dem Index anstrebt, unterscheiden sich seine Bestände von denen des Index. Weitere Angaben zu den Arten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert, entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Zugelassene Anlagen“ weiter unten. Der Fonds wird Wertpapiere halten, die nicht Teil des Index sind. Die Gewichtung der Wertpapiere im Fonds erfolgt gewöhnlich ohne Berücksichtigung der Gewichtung der Indexkomponenten. Die Rendite des Fonds weicht in der Regel von derjenigen des Index ab und kann hinter dieser zurückbleiben.

Der Index basiert auf dem MSCI World Index, seinem übergeordnetem Index, und umfasst Aktien von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung aus Industrieländern. Der Index ist so konzipiert, dass er die Wertentwicklung von Aktien im übergeordneten Index widerspiegelt, die überdurchschnittliche Dividendenerträge und Qualitätsmerkmale aufweisen und sich durch nachhaltige und beständige Dividendenrenditen auszeichnen.

Wie oben dargelegt, wird der Anlageverwalter eine aktive Anlagestrategie verfolgen, die einen fundamental orientierten Bottom-up-Researchprozess zur Identifikation von Unternehmen nutzt, bei denen eine Verzerrung zwischen dem inneren Wert des Unternehmens und dem Preis seiner Aktienwerte besteht. Dies umfasst tiefgreifendes Unternehmens- und Branchenresearch durch die erfahrenen Sektoranalysten des Anlageverwalters, das bei der Bewertung der künftigen Cashflow-Generierung eines Unternehmens zum Einsatz kommt, um so dessen inneren Wert zu ermitteln. Zu den typischen Researchfeldern gehören u. a. die Branchenstruktur in ihrer Gesamtheit, die Wettbewerbsdynamik und das Wachstumsniveau, die Wettbewerbsposition des Unternehmens, der „wirtschaftliche Burggraben“ (die Fähigkeit eines Unternehmens, sich gegenüber seinen Mitbewerbern einen Wettbewerbsvorteil zu sichern) und die Wachstumsaussichten, die Strategie und Erfahrung des Managements, die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung und die finanzielle Widerstandsfähigkeit des Unternehmens. Der Anlageverwalter zielt darauf ab, Bewertungsanomalien

auszunutzen. Er geht davon aus, dass die Aktienkurse langfristig letztlich den inneren Wert eines Unternehmens widerspiegeln und somit Überrenditen erzielen sollten.

Zum Researchprozess gehört eine Überprüfung der ESG-Ratings und anderer ESG-Datenkennzahlen von Unternehmen, sodass der Anlageverwalter Nachhaltigkeitsrisiken in den Anlageprozess des Fonds einbezieht.

Dieser Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 SFDR.

Zu den mit dem Fonds beworbenen ökologischen Merkmalen gehören die Verringerung des ökologischen Fußabdrucks und negativer sozialer Auswirkungen, indem Investitionen in Unternehmen, die in den Bereichen Kraftwerkskohle, Öl- und Gasförderung in der Arktis, Ölsandgewinnung tätig sind, ebenso ausgeschlossen werden wie Unternehmen, die in schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind und Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“) in Bezug auf die Umwelt verstoßen. Für bestimmte Branchen wendet der Anlageverwalter maximale prozentuale Schwellenwerte an, die in der Regel auf den Einnahmen aus Produktion und/oder dem Vertrieb basieren. (Diese können variieren, je nachdem, ob es sich bei dem Emittenten um einen Produzenten, einen Vertreter oder einen Dienstleister handelt). Zu den mit dem Fonds beworbenen sozialen Merkmalen gehören: (a) die Verringerung der Verfügbarkeit von Waffen durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die mit kontroversen Waffen und zivilen Feuerwaffen in Verbindung stehen, (b) die Verringerung gesundheitsschädlicher Auswirkungen durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die mit Tabak in Verbindung stehen, und (c) die Unterstützung von Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die gegen die Grundsätze des UN Global Compact, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung verstoßen, sowie den Ausschluss von Unternehmen, die mit schwerwiegenden ESG-Kontroversen in Verbindung stehen. Weitere Informationen über die ökologischen und sozialen Merkmale sind dem diesem Nachtrags beigefügten SFDR-Anhang zu entnehmen.

Bei der Auswahl der Anlagen wird der Anlageverwalter Wertpapiere von Unternehmen ausschließen, die als nicht konform mit den UNGC-Grundsätzen in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsnormen, Korruptionsbekämpfung und kontroverse Waffen identifiziert werden. Darüber hinaus wird er Wertpapiere von Unternehmen ausschließen, die mit Kraftwerkskohle, Bohrungen in der Arktis, Öl- und Teersanden, Tabak und zivilen Feuerwaffen in Verbindung stehen oder in schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind. Der Anlageverwalter kann jeweils zusätzliche ESG-Filter (Screens) anwenden, um Wertpapiere von Unternehmen auszuschließen, die an Tätigkeiten beteiligt sind, die als nicht konform mit einem oder mehreren der im vorstehenden Satz genannten ESG-Kriterien angesehen werden. Die spezifische Liste der anwendbaren Ausschlüsse kann sich weiterentwickeln und, sofern die Anforderungen der Zentralbank erfüllt werden, jeweils vom Anlageverwalter geändert werden. Soweit eine solche Korrektur zu einer Änderung der Art und Weise führt, wie die Anlagepolitik umgesetzt oder in diesem Nachtrag

beschrieben wird, werden die Anteilinhaber gemäß den Anforderungen der Zentralbank benachrichtigt und der Nachtrag entsprechend auf den neuesten Stand gebracht. Weitere Informationen zu den geltenden Ausschlüssen sind dem diesem Nachtrags beigefügten SFDR-Anhang zu entnehmen.

Taxonomie-Verordnung: Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Fonds ist nicht verpflichtet, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in taxonomiekonforme Anlagen zu investieren. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann ausschließlich zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass die Fondsrendite vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Der Fonds beabsichtigt nicht, sich an einem Wertpapierleihprogramm zu beteiligen, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik des Fonds beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „**Risikoinformationen**“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Aktives Risiko: Die Anlagerendite entspricht in der Regel nicht der des Index.

Anlageentscheidungen des Anlageverwalters, Wertpapiere des Index unter- oder überzugewichten oder die Anlagen im Fonds gegenüber den Indexkomponenten zu variieren, einschließlich in Bezug auf bestimmte Wertpapiere oder breitere Anlagesektoren, haben Einfluss auf die Wertentwicklung des Fonds im Vergleich zum Index.

Darüber hinaus wird die Wertentwicklung des Fonds im Vergleich zum Index durch Kosten des Fonds, den Bestand an liquiden Mitteln im Fonds sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen beeinflusst.

Managementrisiko: Der Fonds wird aktiv verwaltet. Die Einschätzung des Anlageverwalters hinsichtlich der Attraktivität, des relativen Werts oder einer potenziellen Wertsteigerung eines bestimmten Sektors, eines Wertpapiers, eines Rohstoffs oder einer Anlagestrategie kann sich als falsch erweisen und zu Verlusten für den Fonds führen. Es kann nicht garantiert werden, dass die Anlagetechniken und -entscheidungen des Anlageverwalters zu den gewünschten Ergebnissen führen.

Screening-Risiken: Es besteht ein Risiko von Fehlern seitens des Erbringers von Screening-Diensten, etwa eine falsche Beurteilung der Screening-Kriterien und/oder die Aufnahme der falschen/der Ausschluss der richtigen Komponenten im Screening-Prozess oder die Einstellung seiner Screening-Dienste. In einer solchen Situation kann die Gesellschaft einen anderen Erbringer von Screening-Diensten bestellen, obwohl es keine Garantie dafür gibt, dass ein ersetzendes Screening zu einem ähnlichen Filterverfahren wie dem Vorgesehenen führen würde oder überhaupt verfügbar wäre.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen

gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine geringe Zahl von Aktien, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die diese geringe Zahl von Aktien betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die die Aktien, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Schwellenländerrisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe.

Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in der Volksrepublik China: Neben den Risiken von Anlagen in Schwellenländern zählen zu den Risiken von Anlagen in der VRC unter anderem Handelsaussetzungen, Beschränkungen von Währungstransfers/-engagements, Grenzen für das Halten von Anlagen in der VRC und die Inanspruchnahme von Maklern, nicht erprobte Konzepte für die Handhabung des wirtschaftlichen Eigentums, die Abhängigkeit von Zugangsprogrammen, die eingestellt oder wesentlich verändert werden können, technologische Systemrisiken und Kontrollen im Zusammenhang mit solchen Zugangsprogrammen, Verwahrstellenrisiken, einschließlich einer mangelnden Trennung der Vermögenswerte des Antragstellers und anderer Intermediäre im Rahmen der betreffenden Zugangsprogramme und der betreffenden Unterdepotbanken, sowie steuerliche Unsicherheiten.

Risiko im Zusammenhang mit Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren: Die Marktkurse von Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren können steigen oder fallen, manchmal schnell und unvorhersehbar. Der Wert dieser Wertpapiere kann aus Gründen fallen, die direkt mit dem Emittenten zusammenhängen und/oder aufgrund von allgemeinen Branchen- oder Marktbedingungen, wie z. B. tatsächlichen oder wahrgenommenen widrigen Wirtschaftsbedingungen, Veränderungen im allgemeinen Ausblick für Unternehmensgewinne, Zins- oder Wechselkursänderungen oder einer allgemein negativen Anlegerstimmung. Aktienmärkte bewegen sich zyklisch. Das kann dazu führen, dass Aktienkurse über kürzere oder längere Zeiträume fallen.

Einbeziehung von ESG: Die Einbeziehung von ESG bezeichnet die Einbeziehung qualitativer und quantitativer ESG-Informationen in den Anlageprozess, einschließlich Nachhaltigkeitsrisiken, und soll Anlageentscheidungen optimieren. Der Anlageverwalter integriert ESG-Kriterien, um die finanzielle Performance zu verbessern und/oder finanzielle Risiken zu mindern. Der Anlageverwalter berücksichtigt ESG-Faktoren explizit und systematisch in der Anlageanalyse und den Anlageentscheidungen, um die Risiken zu senken und Erträge zu generieren. Die Einbeziehung von ESG ist ein breit angelegtes Instrument, bei dem wesentliche ESG-Komponenten als Risiko- und/oder Renditetreiber betrachtet werden und nicht als Mittel, um bestimmte ökologische, soziale und/oder die Unternehmensführung betreffende Ziele zu erreichen. Der Anlageverwalter wird beurteilen, ob und wie finanziell wesentliche ESG-Themen in seine Entscheidungsprozesse integriert werden, er wird angemessene ESG-Signale und -Faktoren zur Risikominderung berücksichtigen und Chancen für das langfristige Performancepotenzial ermitteln.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken in den Anlageprozess des Fonds garantiert nicht die Minderung aller oder einzelner Nachhaltigkeitsrisiken. Der Anlageverwalter hat die wahrscheinlichen Auswirkungen von Nachhaltigkeitsrisiken auf die Renditen des Fonds bewertet. Dabei kam er zu dem Schluss, dass Nachhaltigkeitsrisiken die Volatilität des Fonds erhöhen und / oder bereits bestehende Risiken für den Fonds verstärken können, dies aber voraussichtlich nicht tun, und dass sich diese erheblich negativ auf den Wert des Portfolios auswirken können. Nachhaltigkeitsrisiken können besonders akut sein, wenn sie unerwartet oder plötzlich auftreten. Derartige Risiken können einen weiteren Abwärtsdruck auf den Wert des Fonds ausüben und Anleger dazu veranlassen, ihre Anlage zu überdenken. Nachhaltigkeitsrisiken werden gemäß der oben unter „Anlagepolitik“ beschriebenen Anlagestrategie des Fonds in die Anlageentscheidungen des Anlageverwalters einbezogen. So kann der Anlageverwalter beispielsweise versuchen, bestimmte Nachhaltigkeitsrisiken durch die Anwendung von ESG-Filtern und anderen Kriterien, wie in der Anlagepolitik beschrieben, zu mindern. Die Verpflichtung des Fonds, mindestens 25 % in nachhaltige Investitionen zu investieren, kann ebenfalls zu einer potenziellen Minderung des Nachhaltigkeitsrisikos beitragen.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko: Die SFDR erlegt den Teilnehmern an den Finanzmärkten neue Offenlegungspflichten auf. Zum Datum dieses Nachtrags wurden die technischen Regulierungsstandards zur Umsetzung (Stufe 2) für die SFDR von der Europäischen Kommission verabschiedet. Sie sind seit dem 1. Januar 2023 in Kraft, doch sind einige der von der SFDR eingeführten Konzepte derzeit nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Der Fonds wurde in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Nachtrag und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Informationen und Klassifizierungen gemäß Artikel 8 Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die langfristig von der Wertentwicklung eines konzentrierten Portfolios mit Papieren aus hochrentierlichen globalen Aktienmärkten in Industrie- und Schwellenländern profitieren möchten und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 10 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Kosten und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

Index-Haftungsausschlüsse:

Der MSCI World High Dividend Yield Index wurde von State Street Global Advisors Europe Limited als Referenzwert und/oder Referenzuniversum für die Auswahl der Unternehmen verwendet, die als Grundlage für den State Street Global Dividend Spotlight Active Equity UCITS ETF dienen. MSCI sponsert, unterstützt, bewirbt oder empfiehlt den State Street Global Dividend Spotlight Active Equity UCITS ETF in keiner Weise. MSCI war und ist in keiner Weise an der Zusammenstellung, Berechnung, Pflege oder Überprüfung des State Street Global Dividend Spotlight Active Equity UCITS ETF beteiligt. Der MSCI World High Dividend Yield Index wurde „ohne Gewähr“ zur Verfügung gestellt. MSCI, alle seine verbundenen Unternehmen und alle anderen Personen, die an der Zusammenstellung, Berechnung oder Schaffung des MSCI World High

Dividend Yield Index beteiligt oder damit verbunden sind (zusammenfassend die „MSCI-Parteien“), lehnen ausdrücklich jegliche Gewährleistungen ab (insbesondere Gewährleistungen hinsichtlich Echtheit, Richtigkeit, Vollständigkeit, Aktualität, Nichtverletzung von Rechten Dritter, Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck). Unbeschadet des Vorstehenden haften die MSCI-Parteien in keinem Fall für unmittelbare, mittelbare, konkrete oder beiläufige Schäden, Strafe einschließenden Schadenersatz oder Folgeschäden (insbesondere entgangene Gewinne) oder sonstige Schäden im Zusammenhang mit dem MSCI World High Dividend Yield Index oder dem State Street Global Dividend Spotlight Active Equity UCITS ETF.

SFDR-Anhang ANHANG II

Vorlage – Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: State Street Global Dividend Spotlight Active Equity UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung: 984500N70AP4Y2EX7A83

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☒ ☐ Ja	☒ ☐ ☒ Nein
☐ Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ____%	☒ Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 25 % an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ Es wird damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es werden damit ein Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ____%	☐ Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Zu den mit dem Fonds beworbenen ökologischen Merkmalen gehören:

i) eine Verringerung des ökologischen Fußabdrucks und negativer sozialer Auswirkungen, indem Investitionen in Unternehmen, die in den Bereichen Kraftwerkskohle, Öl- und Gasexploration in der Arktis und Ölsandgewinnung tätig sind, ebenso ausgeschlossen werden wie Unternehmen, die in schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind und Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“) in Bezug auf die Umwelt (Grundsätze 7 bis 9) verstoßen.

Zu den mit dem Fonds beworbenen sozialen Merkmalen gehören:

i) eine Verringerung der Verfügbarkeit von Waffen durch den Ausschluss von Investitionen in

Unternehmen, die mit kontroversen Waffen und zivilen Feuerwaffen in Verbindung stehen;

ii) eine Verringerung gesundheitsschädlicher Auswirkungen durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die mit Tabak in Verbindung stehen; und

iii) die Unterstützung von Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die gegen die UNGC-Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte (Grundsätze 1 und 2), Arbeit (Grundsätze 3 bis 6) und Korruptionsbekämpfung (Grundsatz 10) verstoßen, sowie in Unternehmen, die mit schwerwiegenden ESG-Kontroversen in Verbindung stehen.

Die UNGC-Grundsätze stehen für die weltweit größte Initiative für unternehmerische Nachhaltigkeit, die darauf abzielt, dass Unternehmen ihre Strategien und Tätigkeiten an universellen Grundsätzen zu Menschenrechten, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung ausrichten und Maßnahmen ergreifen, die soziale Ziele fördern.

Geschäftliche Beteiligung: Die Definition von „beteiligt“ in Bezug auf jede der oben genannten Tätigkeiten wird anhand der firmeneigenen Methode des Anlageverwalters festgelegt. Jede Tätigkeit kann auf der Erwirtschaftung oder Ableitung von Umsätzen aus der Tätigkeit beruhen, die einen prozentualen Umsatzanteil oder eine festgelegte Gesamtumsatzschwelle übersteigt, oder auf einem Engagement in der Tätigkeit, ungeachtet der Höhe der vereinnahmten Umsätze. Gemäß der firmeneigenen Methode des Anlageverwalters kann sich die Tätigkeit auf die Produktion oder den Vertrieb oder beides beziehen. Für bestimmte Branchen wendet der Anlageverwalter maximale prozentuale Schwellenwerte an, die in der Regel auf den Einnahmen aus Produktion und/oder dem Vertrieb basieren. (Diese können variieren, je nachdem, ob es sich bei dem Emittenten um einen Produzenten, einen Vertreiber oder einen Dienstleister handelt), wie nachstehend aufgeführt:

Kraftwerkskohle	Förderung und/oder Verstromung, Höhe der Beteiligung $\geq 10\%$
Arktisches Öl & Gas	Förderung, Höhe der Beteiligung $\geq 10\%$
Ölsand	Gewinnung, Höhe der Beteiligung $\geq 10\%$
schwerwiegende ESG-Kontroversen	Kategorie 5 — schwerwiegende Kontroversen
Grundsätze des UN Global Compact	Verstöße gegen die Grundsätze des Global Compact = Nicht konform
Kontroverse Waffen	Herstellung und Wartung von Kernwaffensystemen oder -komponenten. Höhe der Beteiligung = „True“ oder $\geq 10\%$
Zivile Feuerwaffen	Herstellung und/oder Verkauf von Kleinwaffen und der dazugehörigen Munition/den Komponenten für zivile Zwecke. Höhe der Beteiligung $\geq 10\%$
Tabak	Produktion und Herstellung von Tabak und tabakbezogenen Produkten, Höhe der Beteiligung $\geq 10\%$

Die spezifische Liste der anwendbaren Ausschlüsse kann sich weiterentwickeln und, sofern die Anforderungen der Zentralbank erfüllt werden, jeweils vom Anlageverwalter geändert werden. Weitere Einzelheiten zu den Ausschlusskriterien, die der Anlageverwalter zu jeder Zeit zwecks der Bewertung ökologischer und/oder sozialer Merkmale anwendet, sowie die Definitionen der Begriffe „beteiligt“, „Beteiligung“ und „in Verbindung“ sowie die Schwellenwerte und Kriterien, die bei der Bewertung der oben genannten Umsätze und Geschäftsbeteiligungen angewendet werden, finden Sie unter dem folgenden Link: https://www.ssga.com/ie/en_gb/institutional/fund-finder?tab=documents&type=uk-etfs

Mit dem Fonds werden außerdem die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale im Zusammenhang mit der Reduzierung von CO₂-Emissionen beworben, indem er seine Investitionen auf Unternehmen so ausrichtet, dass das Portfolio des Fonds insgesamt geringere CO₂-Emissionen aufweist als der MSCI World High Dividend Yield Index (der „Index“), gemessen an der durchschnittlichen gewichteten CO₂-Intensität (Weighted Average Carbon Intensity – „WACI“).

Der Fonds legt mindestens 25 % seines Portfolios in nachhaltigen Investitionen an. Damit das Wertpapier als nachhaltige Anlage für den Fonds in Frage kommt, muss es vom Anlageverwalter anhand des Nachhaltigkeitsratings (anhand seines firmeneigenen Verfahrens zur Bewertung der Nachhaltigkeit, das „Nachhaltigkeitsrating“) als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden (siehe „Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?“).

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Die Erreichung der ökologischen Merkmale wird durch die Erzielung eines höheren Engagements des Fondsportfolios in solchen Unternehmen gemessen, die bewirken, dass das Gesamtportfolio des Fonds (im Vergleich zum Index) gemessen an der WACI geringere CO₂-Emissionen aufweist. Die WACI misst das Engagement eines Portfolios in CO₂-intensiven Unternehmen. Die Berechnung der WACI des Portfolios erfolgt durch die Berechnung der CO₂-Intensität (Scope-1-+-2-Emissionen/Mio. USD Umsatz) eines jeden Portfoliounternehmens und die Berechnung des gewichteten Durchschnitts nach Portfoliogewichtung. Die CO₂-Emissionen werden auf der Grundlage der Portfoliogewichtung/des Engagements und nicht auf der Grundlage des Anteils der Emissionen oder Umsätze, die ein Anleger hält, aufgeteilt.

Eine weitere Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen Merkmale wird gemessen anhand:

- des Prozentsatzes des Portfolios, der in Wertpapiere investiert ist, die gegen die UNGC-Grundsätze in Bezug auf die Umwelt verstoßen und die in den Bereichen Kraftwerkskohle, arktische Öl- und Gasförderung sowie Ölsandgewinnung tätig sind. Das Engagement in solchen Wertpapieren wird voraussichtlich bei 0 % des Anteils der Wertpapiere liegen, die die oben genannten Kriterien für eine geschäftliche Beteiligung erfüllen.

Die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen Merkmale wird gemessen anhand:

- des Prozentsatzes des Portfolios, der in Wertpapiere investiert ist, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen, sowie in Unternehmen, die mit kontroversen Waffen, zivilen Feuerwaffen und Tabak in Verbindung stehen und solchen, die in schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind. Das Engagement in solchen Wertpapieren wird voraussichtlich bei 0 % des Anteils der Wertpapiere liegen, die die oben genannten Kriterien für eine geschäftliche Beteiligung erfüllen.

Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen erfolgen in Unternehmen, die nach Einschätzung des Anlageverwalters in einer wirtschaftlichen Tätigkeit operieren, die entweder zu einem ökologischen (z. B. THG-Emissionen, Wassermanagement und ökologische Auswirkungen) oder sozialen (z. B. Menschenrechte und Mitarbeiterbindung, Vielfalt und Inklusion) Ziel beiträgt.

Der Anlageverwalter führt Analysen durch, um Unternehmen zu identifizieren, die zur Erreichung dieser ökologischen und/oder sozialen Ziele beitragen, indem er Daten von mehreren Anbietern von Nachhaltigkeitsdaten heranzieht, auf deren Grundlage er für jedes Wertpapier ein Nachhaltigkeitsrating erstellt.

Damit ein Wertpapier als nachhaltige Investition infrage kommt, muss das Unternehmen gemäß dem firmeneigenen Nachhaltigkeitsrating ein „Vorreiter“ oder „Outperformer“ sein. Ein „Vorreiter“ oder „Outperformer“ ist als ein Wertpapier definiert, das im besten 30. Perzentil des Nachhaltigkeitsuniversums des Anlageverwalters liegt, wie von ihm anhand des durch den firmeneigenen Prozess generierten Nachhaltigkeitsratings ermittelt.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nachhaltige Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden, sollten ökologisch oder sozial nachhaltige Investitionsziele nicht erheblich beeinträchtigen. In dieser Hinsicht berücksichtigt der Anlageverwalter die verbindlichen Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („**PAIs**“), wie in Tabelle 1, Anhang 1 der Stufe 2 der SFDR zu Nachhaltigkeitsfaktoren festgelegt, d. h. durch die Einbeziehung des Wesentlichkeitsrahmens des SASB in das Nachhaltigkeitsrating des Anlageverwalters und die Anwendung der oben dargelegten Ausschlüsse. Durch die Anlage in Wertpapieren, die gemäß dem firmeneigenen Nachhaltigkeitsrating des Anlageverwalters als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden, und die

Anwendung der oben genannten Ausschlüsse ist der Anlageverwalter der Ansicht, dass die nachhaltigen Investitionen des Fonds kein ökologisch oder sozial nachhaltiges Investitionsziel erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die verbindlichen PAIs werden sowohl durch die Einbeziehung des Wesentlichkeitsrahmens des SASB in das firmeneigene Nachhaltigkeitsrating des Anlageverwalters als auch durch die Anwendung der negativen und normenbasierten Filter in den Kriterien berücksichtigt, die der Anlageverwalter für ein Wertpapier entwickelt hat, um als nachhaltige Investition betrachtet zu werden. So werden Investitionen ausgeschlossen, die als ein ökologisch oder sozial nachhaltiges Investitionsziel beeinträchtigend gelten.

Ein Beispiel für normbasiertes Screening ist der Ausschluss von Wertpapieren, die von Unternehmen emittiert wurden, die nach Research als gegen internationale Normen in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsrichtlinien und Antikorruption verstoßend befunden wurden. Ein Beispiel für einen negativen Filter ist der Ausschluss von Wertpapieren, die von Unternehmen emittiert wurden, die nach Research als im Bereich von kontroversen Waffen gemäß Festlegung im Übereinkommen über Streumunition tätig befunden wurden, und/oder die Ausschlüsse von Unternehmen auf der Grundlage anderer ESG-Kriterien wie etwa die ESG-Ratingschwellen.

Unternehmen, die im Rahmen des firmeneigenen Nachhaltigkeitsratings des Anlageverwalters, der auf dem Wesentlichkeitsrahmen des SASB basiert, als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden und die nicht durch die negativen und normenbasierten Filter ausgeschlossen werden, gelten als nachhaltige Investitionen und stellen daher keine erhebliche Beeinträchtigung eines ökologisch oder sozial nachhaltigen Investitionsziels dar. Die vorab festgelegten negativen und normenbasierten Filter werden eingesetzt, damit Unternehmen, die als nicht konform mit den Grundsätzen des UNGC (in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsnormen, Korruptionsbekämpfung) eingestuft werden, sowie ebenfalls Unternehmen, die mit schwerwiegenden ESG-Kontroversen, umstrittenen Waffen, zivilen Schusswaffen, Kraftwerkskohle, Öl- und Gasexploration in der Arktis sowie Ölsandgewinnung und Tabak in Verbindung gebracht werden, nicht als nachhaltige Investitionen betrachtet werden.

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Eine nachhaltige Investition, wie vom Anlageverwalter festgelegt, schließt keine Unternehmen ein, die nach Auffassung des Anlageverwalters gegen die Grundsätze des UNGC verstoßen. Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte werden bei der Bewertung der Grundsätze des United Nations Global Compact berücksichtigt.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?



Ja,

Der Fonds strebt nach einer Reduzierung der durch die zugrunde liegenden Investitionen verursachten negativen externen Effekte. Dabei berücksichtigt er als Teil der Prüfung der nachhaltigen Investitionen bei der Auswahl der Wertpapiere für den Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“) zu Nachhaltigkeitsfaktoren und wendet zudem negative und normbasierte ESG-Filter vor der Zusammenstellung des Portfolios an. Der Fonds berücksichtigt insbesondere:

- Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze
- Engagement in umstrittenen Waffen

Weitere Informationen zu den PAI finden Sie in den regelmäßigen Fondsberichten.

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Diese Strategie nutzt einen firmeneigenen, fundamental orientierten Bottom-up-Researchprozess zur Identifikation von Unternehmen, bei denen eine erhebliche Verzerrung zwischen dem geschätzten inneren Wert des Unternehmens und dem Preis seiner Aktienwerte besteht. Auf Basis der sich daraus ergebenden Anlagegelegenheiten wird ein ausgewogenes globales Portfolio aus 30 bis 40 Wertpapieren zusammengestellt, die nach Überzeugung des Anlageverwalters das Potenzial haben, Überrenditen zu generieren. Bei der Auswahl der Anlagen wird der Anlageverwalter weder einen bestimmten geografischen noch einen sektoralen Schwerpunkt setzen.

Der Anlageverwalter wird eine aktive Anlagestrategie verfolgen, die einen fundamental orientierten Bottom-up-Researchprozess zur Identifikation von Unternehmen nutzt, bei denen eine Verzerrung zwischen dem inneren Wert des Unternehmens und dem Preis seiner Aktienwerte besteht. Dies umfasst tiefgreifendes Unternehmens- und Branchenresearch durch die erfahrenen Sektoranalysten des Anlageverwalters, das bei der Bewertung der künftigen Cashflow-Generierung eines Unternehmens zum Einsatz kommt, um so dessen inneren Wert zu ermitteln. Zu den typischen Researchfeldern gehören u. a. die Branchenstruktur in ihrer Gesamtheit, die Wettbewerbsdynamik und das Wachstumsniveau, die Wettbewerbsposition des Unternehmens, der „wirtschaftliche Burggraben“ (die Fähigkeit eines Unternehmens, sich gegenüber seinen Mitbewerbern einen Wettbewerbsvorteil zu sichern) und die Wachstumsaussichten, die Strategie und Erfahrung des Managements, die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung und die finanzielle Widerstandsfähigkeit des Unternehmens.

Bei der Umsetzung dieser Strategie wendet der Anlageverwalter vor der Zusammenstellung des Fondsportfolios und fortlaufend einen negativen und normbasierten ESG-Filter an. Der Fonds schließt Wertpapiere von Emittenten aus, die die UNGC-Grundsätze in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung nicht einhalten oder mit schwerwiegenden ESG-Kontroversen, kontroversen Waffen, zivilen Feuerwaffen, Tabak, Kraftwerkskohle, Öl- und Gasförderung in der Arktis und Ölsandgewinnung in Verbindung stehen. Schließlich werden die CO₂-Emissionen des Portfolios unter denen des Referenzwerts gehalten, gemessen anhand der WACI (siehe oben).

Der Fonds kann jeweils zusätzliche ESG-Filter anwenden, um Wertpapiere von Unternehmen auszuschließen, die an Tätigkeiten beteiligt sind, die als nicht konform mit einem oder mehreren der im vorstehenden Absatz genannten ESG-Kriterien angesehen werden.

Die **Anlagestrategie** dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Um die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, wendet der Anlageverwalter vor der Zusammenstellung des Portfolios und fortlaufend, wie im vorigen Abschnitt beschrieben, einen negativen und normbasierten ESG-Filter an (wie oben beschrieben).

Die vorstehende Liste ist ein nicht erschöpfendes Verzeichnis der Ausschlusskriterien, und der Anlageverwalter kann jeweils zusätzliche ESG-Filter anwenden, um Wertpapiere aus dem Portfolio auszuschließen, wenn sie nach seinem Ermessen eines oder mehrere der von ihm festgelegten ESG-Kriterien nicht erfüllen.

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

k. A.

Die Verfahrensweisen einer **guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.

Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?

Die Beurteilung der Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung wird vom Anlageverwalter bei der Umsetzung des Anlageziels und der Anlagepolitik des Fonds im Rahmen der Bewertung potenzieller Investitionen berücksichtigt. Der Anlageverwalter setzt einen firmeneigenen Beurteilungsrahmen für die Unternehmensführung ein, der eine Governance-Scorecard und eine qualitative Bewertung umfasst. Der Beurteilungsrahmen berücksichtigt Faktoren wie die Unabhängigkeit, Diversität und Erfahrung des Verwaltungsrats sowie die Gestaltung der Vergütung der Leitungs- und Führungskräfte sowie die Einhaltung von Rechnungslegungs- und Steuervorschriften. Die Beurteilung der Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung erfolgt zudem über das vom Fonds angewandte Negativ-Screening. Unternehmen, die nach Einschätzung des Anlageverwalters nicht gegen die UNGC-Grundsätzen verstoßen, gelten als eine gute Unternehmensführung aufweisend.



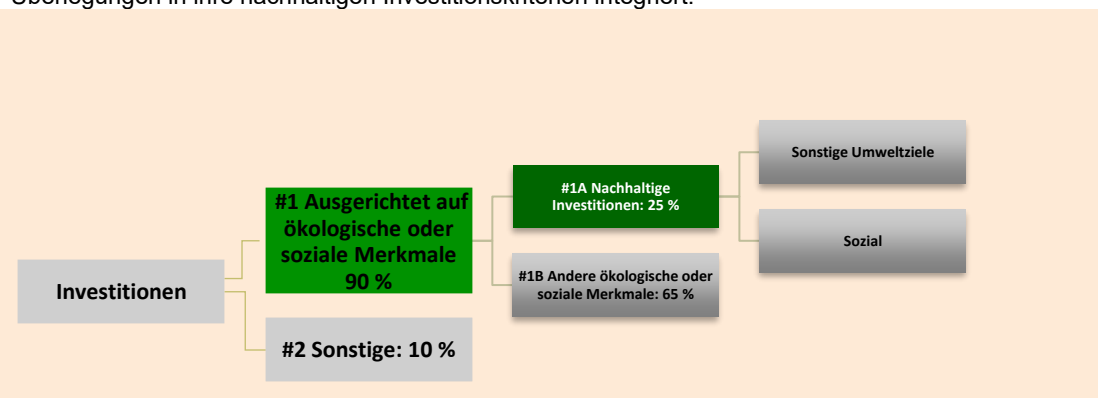
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Der Anlageverwalter verwendet eine verbindliche ESG-Methode, die den Aufbau eines Portfolios verfolgt, in dem mindestens 90 % des Fondsvermögens in Wertpapieren investiert sind, die unter „#1 Ausgerichtet auf ökologische und soziale Merkmale“ fallen, wie in nachstehender Tabelle angegeben. Es ist beabsichtigt, dass innerhalb dieses Teils des Portfolios mindestens 25 % des Fondsvermögens in Wertpapiere investiert werden, bei denen es sich um nachhaltige Investitionen mit ökologischen und/oder sozialen Zielen handelt. Der verbleibende Teil (<10 %) des Portfolios, bestehend aus sowohl Zahlungsmitteln als auch Zahlungsmitteläquivalenten, einschließlich derivativer Finanzinstrumente, die zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements oder zu Absicherungszwecken eingesetzt werden und nach Ermessen des Anlageverwalters gehalten werden, wird in der nachstehenden Tabelle unter „#2 Andere Investitionen“ klassifiziert, ist nicht auf die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet.

Der Fonds verpflichtet sich nicht ausdrücklich zu einer separaten Allokation in sozial nachhaltigen Investitionen, die sich von ökologisch nachhaltigen Investitionen unterscheiden. Dieser Ansatz spiegelt die breitere ESG-Strategie des Fonds wider, die sowohl ökologische als auch soziale Überlegungen in ihre nachhaltigen Investitionskriterien integriert.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen



Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie #1A Nachhaltige Investitionen umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.
- Die Unterkategorie #1B Andere ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Soweit der Fonds ausschließlich zum Zweck des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzt, werden diese nicht zur Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Daher verpflichtet sich der Fonds nicht, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in Anlagen zu investieren, die der Taxonomie-Verordnung entsprechen. Daher ist zu beachten, dass dieser Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Taxonomie-Verordnung nicht berücksichtigt. Es ist daher keine Ausrichtung des Portfolios an der Taxonomie-Verordnung geplant.

Es ist keine Ausrichtung an der Taxonomie-Verordnung beabsichtigt.

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxoniekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐

Ja:

☐

In fossiles Gas

☐

n Kernenergie



Nein

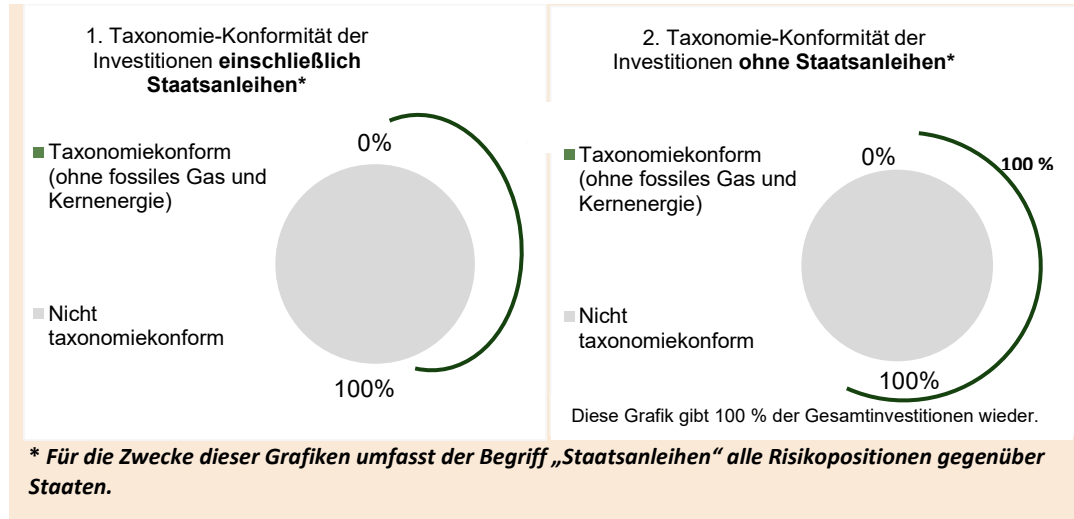
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxoniekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxoniekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Da sich der Fonds nicht verpflichtet, in „ökologisch nachhaltige Investitionen“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung zu investieren, wurde der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten deshalb auch mit 0 % angesetzt.



Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Fonds beabsichtigt, mindestens 0 % seines Vermögens in nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel zu investieren, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind. Die Festlegung der Bewertung der Fondsinvestitionen, die als nachhaltig eingestuft werden, erfolgt in der Regel monatlich, wenn die ESG-Bewertungen aktualisiert werden.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Fonds beabsichtigt, mindestens 0 % seines Vermögens in nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen und/oder sozialen Ziel zu investieren, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind. Die Festlegung der Bewertung der Fondsinvestitionen, die als nachhaltig eingestuft werden, erfolgt in der Regel monatlich, wenn die ESG-Bewertungen aktualisiert werden.

Während der Fonds sich zwar zu 25 % an nachhaltigen Investitionen verpflichtet, besteht keine ausdrückliche Verpflichtung zu einer separaten Allokation in sozial/ökologisch nachhaltigen Investitionen, die sich von der allgemeinen 25 %-igen Allokation des Fonds zu nachhaltigen Investitionen unterscheidet. Dieser Ansatz spiegelt die breitere ESG-Strategie des Fonds wider. Sie integriert sowohl ökologische als auch soziale Aspekte in ihre nachhaltigen Investitionskriterien, ohne jedoch die Allokation zwischen ökologischen und sozialen Zielen spezifisch aufzuschlüsseln oder sie an der EU-Taxonomie auszurichten.



Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen Teil seines Vermögens in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten sowie in Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden und die in der vorstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft werden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Nein

Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?

k. A.

Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?

k. A.

Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?

k. A.

Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?

k. A.

Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:

Anlagen in SPDR Exchange Traded Funds (ETFs) (ssga.com)



State Street World Small Cap Enhanced Active Equity UCITS ETF

Nachtrag Nr. 74

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street World Small Cap Enhanced Active Equity UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street World Small Cap Enhanced Active Equity UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Der Fonds ist ein aktiv verwalteter Fonds.

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, vierteljährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Februar, Mai, August und Dezember jeden Jahres), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei allen thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel-8-Fonds, bezieht Nachhaltigkeitsrisiken ein.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit) Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	Für Zeichnungen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag, für Rücknahmen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	MSCI World Small Cap Index (NCUDWI).
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: http://www.msci.com/products/indices/licensing/constituents.html

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

State Street World Small Cap Enhanced Active Equity UCITS ETF

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street World Small Cap Enhanced Active Equity UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,45 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist es, eine Rendite zu erzielen, die über der Wertentwicklung von Small-Cap-Aktien aus Industrieländern weltweit liegt.

Anlagepolitik: Der Fonds wird (bezogen auf den Index) aktiv verwaltet. Die Anlagepolitik des Fonds zielt darauf ab, mittel- und langfristig eine Outperformance des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) zu erzielen. Die Anlagepolitik beinhaltet zudem den Ausschluss von Wertpapieren auf Basis einer Beurteilung ihrer Einhaltung bestimmter ESG-Kriterien, die vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegt werden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter verfolgen eine aktive Anlagestrategie, die auf einem eigenen quantitativen Multi-Faktor-Modell zur Aktienauswahl („Alpha-Modell“) des Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters basiert und zur Beurteilung der Attraktivität von Aktien eingesetzt wird. Dieses Alpha-Modell generiert Renditeprognosen für Aktien. Das Modell basiert auf einer relativen Bewertung jeder Aktie hinsichtlich Qualität, Wert und Stimmung. Das Modell nutzt die natürliche Sprachverarbeitung zur Analyse von Ereignissen oder Nachrichten, die zu Kursbewegungen einer Aktie führen können. Darüber hinaus bewertet das Alpha-Modell die Renditeerwartungen hinsichtlich Sektoren und Länder und beinhaltet eine dynamische Komponente, die sowohl auf titelspezifischen (Bottom-up) als auch auf makroökonomischen (Top-down) Inputs basiert. Bei der Zusammenstellung des Portfolios sind der Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter bemüht, Rendite- und Risikoerwartungen gegeneinander abzuwägen. Zu den definierten Risikoparametern gehören Beschränkungen hinsichtlich der Gewichtung von Ländern, Sektoren und Wertpapieren auf absoluter Basis und im Verhältnis zum Index. Die Performance des Fonds wird gegenüber dem Index gemessen. Da der Fonds aktiv verwaltet wird und eine Outperformance gegenüber dem Index anstrebt, unterscheiden sich seine Bestände von denen des Index. Der Anlageverwalter berücksichtigt in seinem Anlageprozess ESG-Kriterien.

Der Anlageverwalter betrachtet Small-Cap-Aktien als US-amerikanische Aktienwerte, die im MSCI World Small Cap Index oder einem gleichwertigen Index enthalten sind.

Während die meisten Wertpapiere des Fonds in erster Linie Komponenten des Index sind, können die Gewichtungen der Fondsbeteiligungen von den Indexgewichtungen abweichen, um den Fonds bei der Erreichung seines Anlageziels – die Outperformance des Index – zu unterstützen. Weitere Angaben zu den Arten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert, entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Zugelassene Anlagen“ weiter unten. Die Gewichtung der Wertpapiere durch den Fonds unterscheidet sich zwar von der Gewichtung im Index, wird jedoch in der Regel unter Berücksichtigung der Gewichtung der Indexkomponenten festgelegt. Die Rendite des Fonds weicht in der Regel von derjenigen des Index ab und kann hinter dieser zurückbleiben.

Der Index soll die Wertentwicklung kleinerer Unternehmen aus Industrieländern weltweit widerspiegeln. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der

Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Wenngleich der Fonds aufgrund der sich verändernden Volatilität und Renditemerkmale der weltweiten Industrieländer keine absolute Zielrendite und/oder Überrendite gegenüber dem Index anstrebt, wird unter normalen Marktbedingungen in der Regel von einer Rendite oberhalb des Index (nach Abzug von Gebühren und Kosten) bei einem vergleichbaren Risikoprofil ausgegangen. Es besteht die Möglichkeit, dass der Fonds den Index nicht übertrifft oder lediglich verhältnismäßig geringe Nettoerrenditen oberhalb des Index erzielt.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter berücksichtigt bei seinen Anlageentscheidungen Nachhaltigkeitsrisiken und wendet vor der Zusammenstellung des Fondsportfolios sowie fortlaufend einen negativen und normbasierten ESG-Filter an. Das normbasierte Screening bezeichnet den Ausschluss von Wertpapieren, die von Unternehmen emittiert wurden, die im Anschluss an Research als gegen internationale Normen in Bezug auf beispielsweise Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsrichtlinien und Antikorruption verstoßend befunden wurden.

Dieser Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 SFDR. Zu den mit dem Fonds beworbenen ökologischen Merkmalen gehören die Verringerung des ökologischen Fußabdrucks und negativer sozialer Auswirkungen, indem Investitionen in Unternehmen, die in den Bereichen Kraftwerkskohle, Öl- und Gasförderung in der Arktis, Ölsandgewinnung tätig sind, ebenso ausgeschlossen werden wie Unternehmen, die in schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind und Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“) in Bezug auf die Umwelt verstoßen. Für bestimmte Branchen wendet der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter maximale prozentuale Schwellenwerte an, die in der Regel auf den Einnahmen aus Produktion und/oder dem Vertrieb basieren. (Diese können variieren, je nachdem, ob es sich bei dem Emittenten um einen Produzenten, einen Vertreiber oder einen Dienstleister handelt.)

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter betrachtet ESG-Kontroversen als schwerwiegend, wenn Unternehmen in Vorfälle/Ereignisse verwickelt sind, die aufgrund ihrer potenziellen Auswirkungen auf Stakeholder, die Umwelt oder die Geschäftstätigkeit des Unternehmens ein Risiko für die Geschäftstätigkeit oder die Reputation darstellen können. Zu den mit dem Fonds beworbenen sozialen Merkmalen gehören: (a) die Verringerung der Verfügbarkeit von Waffen durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die mit kontroversen Waffen und zivilen Feuerwaffen in Verbindung stehen, (b) die Verringerung gesundheitsschädlicher Auswirkungen durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die mit Tabak in Verbindung stehen, und (c) die Unterstützung von Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die gegen die Grundsätze des UN Global Compact, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung verstoßen, sowie den Ausschluss von Unternehmen, die mit schwerwiegenden ESG-Kontroversen in Verbindung stehen. Weitere Informationen über die ökologischen und sozialen Merkmale sind dem diesem Nachtrags beigefügten SFDR-Anhang zu entnehmen.

Bei der Auswahl der Anlagen wird der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter Wertpapiere von Unternehmen ausschließen, die als nicht konform mit den UNGC-Grundsätzen in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsrichtlinien, Korruptionsbekämpfung und umstrittene Waffen identifiziert werden. Darüber hinaus wird er Wertpapiere von Unternehmen ausschließen, die mit Kraftwerkskohle, Bohrungen in der Arktis, Öl- und Teersanden, Tabak und zivilen Schusswaffen in Verbindung stehen oder in schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind. Der Anlageverwalter kann jeweils zusätzliche ESG-Filter (Screens) anwenden, um Wertpapiere von Unternehmen auszuschließen, die an Tätigkeiten beteiligt sind, die als nicht konform mit einem oder mehreren der im vorstehenden Satz genannten ESG-Kriterien angesehen werden. Die spezifische Liste der anwendbaren Ausschlüsse kann sich weiterentwickeln und, sofern die Anforderungen der Zentralbank erfüllt werden, jeweils vom Anlageverwalter geändert werden. Soweit eine solche Korrektur zu einer Änderung der Art und Weise führt, wie die Anlagepolitik umgesetzt oder in diesem Nachtrag beschrieben wird, werden die Anteilinhaber gemäß den Anforderungen der Zentralbank benachrichtigt und der Nachtrag entsprechend auf den neuesten Stand gebracht.

Taxonomie-Verordnung: Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Fonds ist nicht verpflichtet, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in taxonomiekonforme Anlagen zu investieren. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements oder zu Absicherungszwecken derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden

konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass die Fondsrendite vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“** des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Der Fonds beabsichtigt nicht, sich an einem Wertpapierleihprogramm zu beteiligen, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik des Fonds beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt **„Risikoinformationen“** im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Aktives Risiko: Die Anlagerendite entspricht in der Regel nicht der des Index. Anlageentscheidungen des Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters, Wertpapiere des Index unter- oder überzugewichten oder die Anlagen im Fonds gegenüber den Indexkomponenten zu variieren, einschließlich in Bezug auf bestimmte Wertpapiere oder breitere Anlagesektoren, haben Einfluss auf die Wertentwicklung des Fonds im Vergleich zum Index. Darüber hinaus wird die Wertentwicklung des Fonds im Vergleich zum Index durch Kosten des Fonds, den Bestand an liquiden Mitteln im Fonds sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen beeinflusst.

Managementrisiko: Der Fonds wird aktiv verwaltet. Die Einschätzung des Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters hinsichtlich der Attraktivität, des relativen Werts oder einer potenziellen Wertsteigerung eines bestimmten Sektors, eines Wertpapiers, eines Rohstoffs oder einer Anlagestrategie kann sich als falsch erweisen und zu Verlusten für den Fonds führen. Es kann nicht garantiert werden, dass die Anlagetechniken und -entscheidungen des Anlageverwalters zu den gewünschten Ergebnissen führen.

Modellrisiko: Der Anlageverwalter verwendet zur Renditesteigerung und zum Risikomanagement quantitative Modelle. Unvollkommenheiten, Fehler oder Einschränkungen in diesen Modellen oder ihrer Programmierung könnten den Nutzen, den der Fonds aus der Verwendung der Modelle zieht, einschränken und zu falschen Ergebnissen oder zu Anlageergebnissen führen, die nicht den vom Anlageverwalter erwarteten oder erwünschten Anlageergebnissen entsprechen. Derlei Unvollkommenheiten, Fehler oder Einschränkungen werden möglicherweise nie oder erst dann entdeckt, wenn ein Fonds bereits einen Verlust erlitten (oder eine geringere Performance erzielt) hat. Ferner kann nicht garantiert

werden, dass sich die Modelle unter allen Marktbedingungen wie erwartet verhalten werden.

Screening-Risiken: Es besteht ein Risiko von Fehlern seitens des Erbringers von Screening-Diensten, etwa eine falsche Beurteilung der Screening-Kriterien und/oder die Aufnahme der falschen/der Ausschluss der richtigen Komponenten im Screening-Prozess oder die Einstellung seiner Screening-Dienste. In einer solchen Situation kann die Gesellschaft einen anderen Erbringer von Screening-Diensten bestellen, obwohl es keine Garantie dafür gibt, dass ein ersetzendes Screening zu einem ähnlichen Filterverfahren wie dem Vorgesehenen führen würde oder überhaupt verfügbar wäre.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquiden Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Risiken im Zusammenhang mit kleineren Unternehmen: Die Wertpapiere von Unternehmen mit geringer, mittlerer und kleinster Kapitalisierung reagieren mitunter volatil und werden seltener und in kleineren Stückzahlen gehandelt als die Wertpapiere größerer Unternehmen. Solche Unternehmen verfügen unter Umständen über begrenzte Produktlinien, Märkte oder Finanzmittel, ihre Wettbewerbsstärke kann geringer sein als bei größeren Unternehmen und sie sind womöglich von wenigen Schlüsselpersonen in ihrer Belegschaft abhängig. Hinzu kommt, dass diese Unternehmen möglicherweise nur eine kurze oder gar keine Erfolgshistorie aufweisen.

Konzentrationsrisiko: Konzentriert der Fonds seine Anlagen auf eine geringe Zahl von Aktien, haben finanzielle, wirtschaftliche, geschäftliche und sonstige Entwicklungen, die diese geringe Zahl von Aktien betreffen, größere Auswirkungen auf den Fonds, als wenn er breiter gestreut wäre. Diese Konzentration kann auch die Liquidität des Fonds einschränken. Anleger können als Reaktion auf Faktoren, die die Aktien, auf die der Fonds seine Anlagen konzentriert, beeinträchtigen oder voraussichtlich beeinträchtigen, Fondsanteile in erheblicher Zahl kaufen oder verkaufen.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements oder zu Absicherungszwecken einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiko im Zusammenhang mit Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren: Die Marktkurse von Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren können steigen

oder fallen, manchmal schnell und unvorhersehbar. Der Wert dieser Wertpapiere kann aus Gründen fallen, die direkt mit dem Emittenten zusammenhängen und/oder aufgrund von allgemeinen Branchen- oder Marktbedingungen, wie z. B. tatsächlichen oder wahrgenommenen widrigen Wirtschaftsbedingungen, Veränderungen im allgemeinen Ausblick für Unternehmensgewinne, Zins- oder Wechselkursänderungen oder einer allgemein negativen Anlegerstimmung. Aktienmärkte bewegen sich zyklisch. Das kann dazu führen, dass Aktienkurse über kürzere oder längere Zeiträume fallen.

Einbeziehung von ESG: Die Einbeziehung von ESG bezeichnet die Einbeziehung qualitativer und quantitativer ESG-Informationen in den Anlageprozess, einschließlich Nachhaltigkeitsrisiken, und soll Anlageentscheidungen optimieren. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter integriert ESG-Kriterien, um die finanzielle Performance zu verbessern und/oder finanzielle Risiken zu mindern. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter berücksichtigt ESG-Faktoren explizit und systematisch in der Anlageanalyse und den Anlageentscheidungen, um die Risiken zu senken und Erträge zu generieren. Die Einbeziehung von ESG ist ein breit angelegtes Instrument, bei dem wesentliche ESG-Komponenten als Risiko- und/oder Renditetreiber betrachtet werden und nicht als Mittel, um bestimmte ökologische, soziale und/oder die Unternehmensführung betreffende Ziele zu erreichen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter wird beurteilen, ob und wie finanziell wesentliche ESG-Themen in seine Entscheidungsprozesse integriert werden, er wird angemessene ESG-Signale und -Faktoren zur Risikominderung berücksichtigen und Chancen für das langfristige Performancepotenzial ermitteln.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken in den Anlageprozess des Fonds garantiert nicht die Minderung aller oder einzelner Nachhaltigkeitsrisiken. Der Anlageverwalter hat die wahrscheinlichen Auswirkungen von Nachhaltigkeitsrisiken auf die Renditen des Fonds bewertet. Dabei kam er zu dem Schluss, dass Nachhaltigkeitsrisiken die Volatilität des Fonds erhöhen und / oder bereits bestehende Risiken für den Fonds verstärken können, dies aber voraussichtlich nicht tun, und dass sich diese erheblich negativ auf den Wert des Portfolios auswirken können. Nachhaltigkeitsrisiken können besonders akut sein, wenn sie unerwartet oder plötzlich auftreten. Derartige Risiken können einen weiteren Abwärtsdruck auf den Wert des Fonds ausüben und Anleger dazu veranlassen, ihre Anlage zu überdenken. Nachhaltigkeitsrisiken werden gemäß der oben unter „Anlagepolitik“ beschriebenen Anlagestrategie des Fonds in die Anlageentscheidungen des Anlageverwalters einbezogen. So kann der Anlageverwalter beispielsweise versuchen, bestimmte Nachhaltigkeitsrisiken durch die Anwendung von ESG-Filtern und anderen Kriterien, wie in der Anlagepolitik beschrieben, zu mindern. Die Verpflichtung des Fonds, mindestens 25 % in nachhaltige Investitionen zu investieren, kann ebenfalls zu einer potenziellen Minderung des Nachhaltigkeitsrisikos beitragen, verglichen mit einer Situation, in der keine solche Verpflichtung eingegangen worden wäre.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko: Die SFDR erlegt den Teilnehmern an den Finanzmärkten neue Offenlegungspflichten auf. Zum Datum dieses Nachtrags wurden die technischen Regulierungsstandards zur Umsetzung (Stufe 2) für die SFDR von der Europäischen Kommission verabschiedet. Sie sind seit dem 1. Januar 2023 in Kraft, doch sind einige der von der SFDR eingeführten Konzepte derzeit nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Der Fonds wurde in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Nachtrag und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Informationen und Klassifizierungen gemäß Artikel 8 Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung von Small-Cap-Aktien aus Industrieländern weltweit suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 10 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Kosten und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

SFDR-Anhang

**Vorlage – Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der
Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten
Finanzprodukten**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: State Street World Small Cap Enhanced Active Equity UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung: 98450045062F2E883D18

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☒ ☐ **Ja**

☒ ☐ ☒ **Nein**

☐ Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ____%

☒ Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 25 % an nachhaltigen Investitionen

☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☒ mit einem sozialen Ziel

☐ Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ____%

☐ Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Zu den mit dem Fonds beworbenen ökologischen Merkmalen gehören:

i) eine Verringerung des ökologischen Fußabdrucks und negativer sozialer Auswirkungen, indem Investitionen in Unternehmen, die in den Bereichen Kraftwerkskohle, Öl- und Gasexploration in der Arktis und Ölsandgewinnung tätig sind, ebenso ausgeschlossen werden wie Unternehmen, die in schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind und Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“) in Bezug auf die Umwelt (Grundsätze 7 bis 9) verstoßen.

Zu den mit dem Fonds beworbenen sozialen Merkmalen gehören:

i) eine Verringerung der Verfügbarkeit von Waffen durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die mit kontroversen Waffen und zivilen Feuerwaffen in Verbindung stehen;

ii) eine Verringerung gesundheitsschädlicher Auswirkungen durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die mit Tabak in Verbindung stehen; und

iii) die Unterstützung von Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung durch den

Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die gegen die UNGC-Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte (Grundsätze 1 und 2), Arbeit (Grundsätze 3 bis 6) und Korruptionsbekämpfung (Grundsatz 10) verstoßen, sowie in Unternehmen, die mit schwerwiegenden ESG-Kontroversen in Verbindung stehen.

Die UNGC-Grundsätze stehen für die weltweit größte Initiative für unternehmerische Nachhaltigkeit, die darauf abzielt, dass Unternehmen ihre Strategien und Tätigkeiten an universellen Grundsätzen zu Menschenrechten, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung ausrichten und Maßnahmen ergreifen, die soziale Ziele fördern.

Geschäftliche Beteiligung: Die Definition von „beteiligt“ in Bezug auf jede der oben genannten Tätigkeiten wird anhand der firmeneigenen Methode des Anlageverwalters festgelegt. Jede Tätigkeit kann auf der Erwirtschaftung oder Ableitung von Umsätzen aus der Tätigkeit beruhen, die einen prozentualen Umsatzanteil oder eine festgelegte Gesamtumsatzschwelle übersteigt, oder auf einem Engagement in der Tätigkeit, ungeachtet der Höhe der vereinnahmten Umsätze. Gemäß der firmeneigenen Methode des Anlageverwalters kann sich die Tätigkeit auf die Produktion oder den Vertrieb oder beides beziehen. Für bestimmte Branchen wendet der Anlageverwalter maximale prozentuale Schwellenwerte an, die in der Regel auf den Einnahmen aus Produktion und/oder dem Vertrieb basieren. (Diese können variieren, je nachdem, ob es sich bei dem Emittenten um einen Produzenten, einen Vertreiber oder einen Dienstleister handelt), wie nachstehend aufgeführt:

Kraftwerkskohle	Förderung und/oder Verstromung, Höhe der Beteiligung ≥ 10 %
Arktisches Öl & Gas	Förderung, Höhe der Beteiligung ≥ 10 %
Ölsand	Gewinnung, Höhe der Beteiligung ≥ 10 %
schwerwiegende ESG-Kontroversen	Kategorie 5 — schwerwiegende Kontroversen
Grundsätze des UN Global Compact	Verstöße gegen die Grundsätze des Global Compact = Nicht konform
Kontroverse Waffen	Herstellung und Wartung von Kernwaffensystemen oder -komponenten. Höhe der Beteiligung = „True“ oder ≥ 10 %
Zivile Feuerwaffen	Herstellung und/oder Verkauf von Kleinwaffen und der dazugehörigen Munition/den Komponenten für zivile Zwecke. Höhe der Beteiligung ≥ 10 %
Tabak	Produktion und Herstellung von Tabak und tabakbezogenen Produkten, Höhe der Beteiligung ≥ 10 %

Die spezifische Liste der anwendbaren Ausschlüsse kann sich weiterentwickeln und, sofern die Anforderungen der Zentralbank erfüllt werden, jeweils vom Anlageverwalter geändert werden.

Weitere Einzelheiten zu den Ausschlusskriterien, die der Anlageverwalter zur Bewertung ökologischer und/oder sozialer Merkmale zu einem beliebigen Zeitpunkt anwendet, sowie die Definitionen der Begriffe „beteiligt“, „Beteiligung“ und „in Verbindung“ sowie die Schwellenwerte und Kriterien, die bei der Bewertung der oben genannten Erträge und Geschäftsbeteiligungen angewendet werden, finden Sie unter folgendem Link: https://www.ssga.com/ie/en_gb/institutional/fund-finder?tab=documents&type=uk-etfs

Der Fonds legt mindestens 25 % seines Portfolios in nachhaltigen Investitionen an. Damit das Wertpapier als nachhaltige Anlage für den Fonds in Frage kommt, muss es vom Anlageverwalter anhand des Nachhaltigkeitsratings (anhand seines firmeneigenen Verfahrens zur Bewertung der Nachhaltigkeit, das „Nachhaltigkeitsrating“) als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden (siehe „Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?“).

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale



Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen Merkmale wird gemessen anhand:

- des Prozentsatzes des Portfolios, der in Wertpapiere investiert ist, die gegen die UNGC-Grundsätze in Bezug auf die Umwelt verstoßen und die in den Bereichen Kraftwerkskohle, arktische Öl- und Gasförderung sowie Ölsandgewinnung tätig sind. Das Engagement in solchen Wertpapieren wird voraussichtlich bei 0 % des Anteils

erreicht werden.

der Wertpapiere liegen, die die oben genannten Kriterien für eine geschäftliche Beteiligung erfüllen.

Die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen Merkmale wird gemessen anhand:

- des Prozentsatzes des Portfolios, der in Wertpapiere investiert ist, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen, sowie in Unternehmen, die mit umstrittenen Waffen, zivilen Schusswaffen und Tabak in Verbindung stehen und solchen, die in schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind. Das Engagement in solchen Wertpapieren wird voraussichtlich bei 0 % des Anteils der Wertpapiere liegen, die die oben genannten Kriterien für eine geschäftliche Beteiligung erfüllen.

Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen erfolgen in Unternehmen, die nach Einschätzung des Anlageverwalters in einer wirtschaftlichen Tätigkeit operieren, die entweder zu einem ökologischen (z. B. THG-Emissionen, Wassermanagement und ökologische Auswirkungen) oder sozialen (z. B. Menschenrechte und Mitarbeiterbindung, Vielfalt und Inklusion) Ziel beiträgt.

Der Anlageverwalter führt Analysen durch, um Unternehmen zu identifizieren, die zur Erreichung dieser ökologischen und/oder sozialen Zielen beitragen, indem er Daten von mehreren Anbietern von Nachhaltigkeitsdaten heranzieht, auf deren Grundlage er für jedes Wertpapier ein Nachhaltigkeitsrating erstellt.

Damit ein Wertpapier als nachhaltige Investition infrage kommt, muss es vom Anlageverwalter anhand des Nachhaltigkeitsratings (das anhand seines hausinternen Nachhaltigkeitsbewertungsverfahrens erstellt wird) als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden. Ein „Vorreiter“ oder „Outperformer“ ist als ein Wertpapier definiert, das im besten 30. Perzentil des Nachhaltigkeitsuniversums des Anlageverwalters liegt, wie von ihm anhand des durch den firmeneigenen Prozess generierten Nachhaltigkeitsratings ermittelt.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nachhaltige Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden, sollten ökologisch oder sozial nachhaltige Investitionsziele nicht erheblich beeinträchtigen. In dieser Hinsicht berücksichtigt der Anlageverwalter die verbindlichen Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („**PAIs**“), wie in Tabelle 1, Anhang 1 der Stufe 2 der SFDR zu Nachhaltigkeitsfaktoren festgelegt, d. h. durch die Einbeziehung des Wesentlichkeitsrahmens des SASB in das Nachhaltigkeitsrating des Anlageverwalters und die Anwendung der oben dargelegten Ausschlüsse. Durch die Anlage in Wertpapieren, die gemäß dem firmeneigenen Nachhaltigkeitsrating des Anlageverwalters als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden, und die Anwendung von Ausschlüssen im Index ist der Anlageverwalter der Ansicht, dass die nachhaltigen Investitionen des Fonds kein ökologisch oder sozial nachhaltiges Investitionsziel erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die verbindlichen PAIs werden sowohl durch die Einbeziehung des Wesentlichkeitsrahmens des SASB in das firmeneigene Nachhaltigkeitsrating des Anlageverwalters als auch durch die Anwendung der negativen und normenbasierten Filter in den Kriterien berücksichtigt, die der Anlageverwalter für ein Wertpapier entwickelt hat, um als nachhaltige Investition betrachtet zu werden. So werden Investitionen ausgeschlossen, die als ein ökologisch oder sozial nachhaltiges Investitionsziel beeinträchtigend gelten. Das normbasierte Screening bezeichnet den Ausschluss von Wertpapieren, die von Unternehmen emittiert wurden, die im Anschluss an Research als gegen internationale Normen in Bezug auf beispielsweise Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsrichtlinien und Antikorruption verstoßend befunden wurden. Ein Beispiel für einen negativen Filter ist der Ausschluss von Wertpapieren, die von Unternehmen emittiert wurden, die nach Research als im Bereich von kontroversen Waffen gemäß Festlegung im Übereinkommen über Streumunition tätig befunden wurden, und/oder die Ausschlüsse von Unternehmen auf der Grundlage anderer ESG-Kriterien wie etwa die ESG-Ratingschwellen.

Unternehmen, die im Rahmen des firmeneigenen Nachhaltigkeitsratings des

Anlageverwalters, der auf dem Wesentlichkeitsrahmen des SASB basiert, als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden und die nicht durch die negativen und normenbasierten Filter ausgeschlossen werden, gelten als nachhaltige Investitionen und stellen daher keine erhebliche Beeinträchtigung eines ökologisch oder sozial nachhaltigen Investitionsziels dar. Die vorab festgelegten negativen und normenbasierten Filter werden eingesetzt, damit Unternehmen, die als nicht konform mit den Grundsätzen des UNGC (in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsnormen, Korruptionsbekämpfung) eingestuft werden, sowie ebenfalls Unternehmen, die mit schwerwiegenden ESG-Kontroversen, umstrittenen Waffen, zivilen Schusswaffen, Kraftwerkskohle, Öl- und Gasexploration in der Arktis sowie Ölsandgewinnung und Tabak in Verbindung gebracht werden, nicht als nachhaltige Investitionen betrachtet werden. *Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:*

Eine nachhaltige Investition, wie vom Anlageverwalter festgelegt, schließt keine Unternehmen ein, die nach Auffassung des Anlageverwalters gegen die Grundsätze des UNGC verstoßen. Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte werden bei der Bewertung der Grundsätze des United Nations Global Compact berücksichtigt.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?



Ja,

Der Fonds strebt nach einer Reduzierung der durch die zugrunde liegenden Investitionen verursachten negativen externen Effekte. Dabei berücksichtigt er als Teil der Prüfung der nachhaltigen Investitionen bei der Auswahl der Wertpapiere für den Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“) zu Nachhaltigkeitsfaktoren und wendet zudem negative und normbasierte ESG-Filter vor der Zusammenstellung des Portfolios an. Der Fonds berücksichtigt insbesondere:

- Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze
- Engagement in umstrittenen Waffen

Weitere Informationen zu den PAI finden Sie in den regelmäßigen Fondsberichten.

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter verfolgen eine aktive Anlagestrategie, die auf einem eigenen quantitativen Multi-Faktor-Modell zur Aktienauswahl („Alpha-Modell“) des Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters basiert und zur Beurteilung der Attraktivität von Aktien eingesetzt wird. Dieses Alpha-Modell generiert Renditeprognosen für Aktien. Das Modell basiert auf einer relativen Bewertung jeder Aktie hinsichtlich Qualität, Wert und Stimmung. Das Modell nutzt die natürliche Sprachverarbeitung zur Analyse von Ereignissen oder Nachrichten, die zu Kursbewegungen einer Aktie führen können. Darüber hinaus bewertet das Alpha-Modell die Renditeerwartungen hinsichtlich Sektoren und Länder und beinhaltet eine dynamische Komponente, die sowohl auf titelspezifischen (Bottom-up) als auch auf makroökonomischen (Top-down) Inputs basiert. Bei der Zusammenstellung des Portfolios sind der Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter bemüht, Rendite- und Risikoerwartungen gegeneinander abzuwägen. Zu den definierten Risikoparametern gehören Beschränkungen hinsichtlich der Gewichtung von Ländern, Sektoren und Wertpapieren auf absoluter Basis und im Verhältnis zum Index.

Im Rahmen dieser Strategie können der Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter in Wertpapiere investieren oder Engagements eingehen, die an anderen Märkten als den im Index enthaltenen registriert sind oder gehandelt werden. Bei der Umsetzung dieser Strategie wendet der Anlageverwalter vor der Zusammenstellung des Fondsportfolios und fortlaufend einen negativen und normbasierten ESG-Filter an. Der Fonds schließt Wertpapiere von Emittenten aus, die die UNGC-Grundsätze in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung nicht einhalten oder mit schwerwiegenden ESG-Kontroversen, kontroversen Waffen, zivilen Feuerwaffen, Tabak, Kraftwerkskohle, Öl- und Gasförderung in der Arktis und Ölsandgewinnung in Verbindung stehen.

Der Fonds kann jeweils zusätzliche ESG-Filter anwenden, um Wertpapiere von Unternehmen auszuschließen, die an Tätigkeiten beteiligt sind, die als nicht konform mit einem oder mehreren der im vorstehenden Absatz genannten ESG-Kriterien angesehen werden.

Die Anlagestrategie dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Um die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, wendet der Anlageverwalter vor der Zusammenstellung des Portfolios und fortlaufend, wie im vorigen Abschnitt beschrieben, einen negativen und normbasierten ESG-Filter an (wie oben beschrieben).

Die vorstehende Liste ist ein nicht erschöpfendes Verzeichnis der Ausschlusskriterien, und der Anlageverwalter kann jeweils zusätzliche ESG-Filter anwenden, um Wertpapiere aus dem Portfolio auszuschließen, wenn sie nach seinem Ermessen eines oder mehrere der von ihm festgelegten ESG-Kriterien nicht erfüllen.

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

k. A.

Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?

Die Beurteilung der Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung erfolgt über das vom Fonds angewandte Negativ-Screening. Unternehmen, die nach Einschätzung des Anlageverwalters nicht gegen die UNGC-Grundsätzen verstoßen, gelten als eine gute Unternehmensführung aufweisend.

Die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

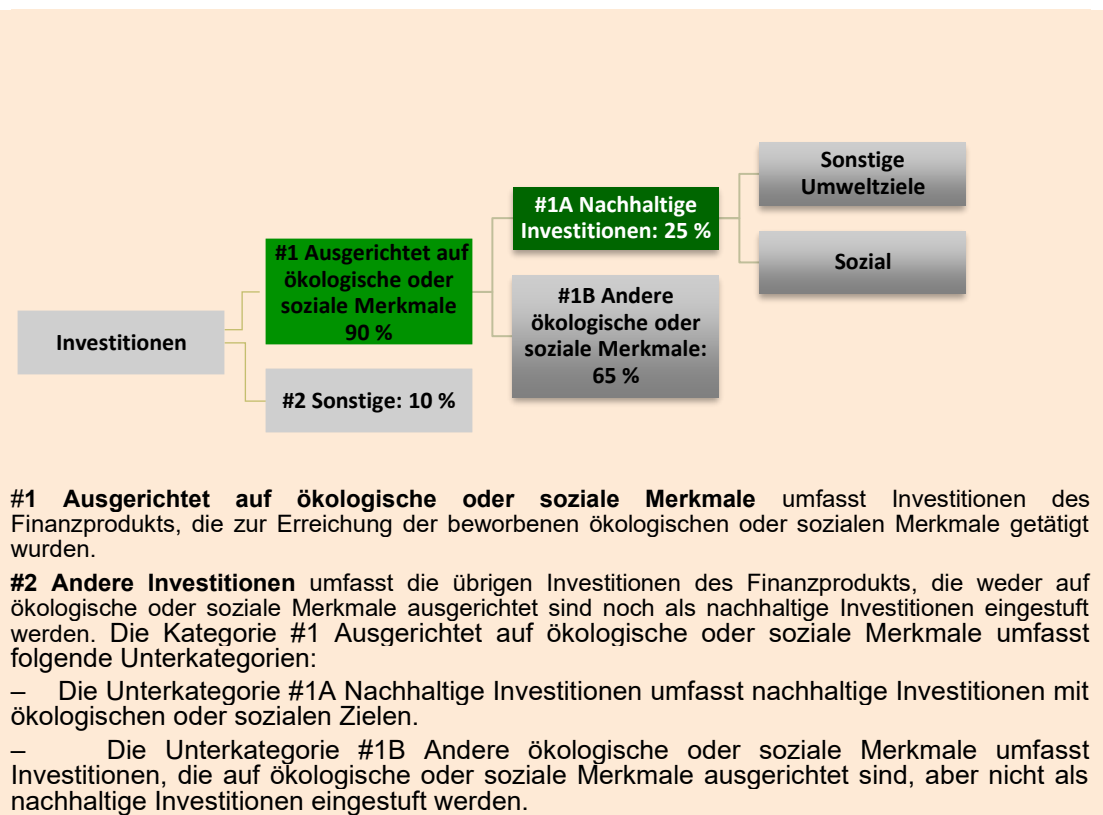
Der Anlageverwalter verwendet eine verbindliche ESG-Methode, die den Aufbau eines Portfolios verfolgt, in dem mindestens 90 % des Fondsvermögens in Wertpapieren investiert sind, die unter „#1 Ausgerichtet auf ökologische und soziale Merkmale“ fallen, wie in nachstehender Tabelle angegeben. Es ist beabsichtigt, dass innerhalb dieses Teils des Portfolios mindestens 25 % des Fondsvermögens in Wertpapiere investiert werden, bei denen es sich um nachhaltige Investitionen mit ökologischen und/oder sozialen Zielen handelt. Der verbleibende Teil (<10 %) des Portfolios, bestehend aus sowohl Zahlungsmitteln als auch Zahlungsmitteläquivalenten, einschließlich derivativer Finanzinstrumente, die zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements oder zu Absicherungszwecken eingesetzt werden und nach Ermessen des Anlageverwalters gehalten werden, wird in der nachstehenden Tabelle unter „#2 Andere Investitionen“ klassifiziert, ist nicht auf die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet.

Der Fonds verpflichtet sich nicht ausdrücklich zu einer separaten Allokation in sozial nachhaltigen Investitionen, die sich von ökologisch nachhaltigen Investitionen unterscheiden. Dieser Ansatz spiegelt die breitere ESG-Strategie des Fonds wider, die sowohl ökologische als auch soziale Überlegungen in ihre nachhaltigen Investitionskriterien integriert.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Soweit der Fonds ausschließlich zum Zweck des effizienten Portfoliomanagements oder zu Absicherungszwecken derivative Finanzinstrumente einsetzt, werden diese nicht zur Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Daher verpflichtet sich der Fonds nicht, mehr als 0 % seines

Nettoinventarwerts in Anlagen zu investieren, die der Taxonomie-Verordnung entsprechen. Daher ist zu beachten, dass dieser Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Taxonomie-Verordnung nicht berücksichtigt. Es ist daher keine Ausrichtung des Portfolios an der Taxonomie-Verordnung geplant.

Es ist keine Ausrichtung an der Taxonomie-Verordnung beabsichtigt.

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹



Ja:



In fossiles Gas



In Kernenergie



Nein

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*

1. Taxonomie-Konformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*

■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

■ Nicht taxonomiekonform



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*

■ Taxonomiekonform (ohne fossiles Gas und Kernenergie)

■ Nicht taxonomiekonform



Diese Grafik gibt 100 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Da sich der Fonds nicht verpflichtet, in „ökologisch nachhaltige Investitionen“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung zu investieren, wurde der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten deshalb auch mit 0 % angesetzt.



Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Fonds beabsichtigt, mindestens 0 % seines Vermögens in nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel zu investieren, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind. Die Festlegung der Bewertung der Fondsinvestitionen, die als nachhaltig eingestuft werden, erfolgt in der Regel monatlich, wenn die ESG-Bewertungen

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

aktualisiert werden.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Fonds beabsichtigt, mindestens 0 % seines Vermögens in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind. Die Festlegung der Bewertung der Fondsinvestitionen, die als nachhaltig eingestuft werden, erfolgt in der Regel monatlich, wenn die ESG-Bewertungen aktualisiert werden.

Während der Fonds sich zwar zu 25 % an nachhaltigen Investitionen verpflichtet, besteht keine ausdrückliche Verpflichtung zu einer separaten Allokation in sozial/ökologisch nachhaltigen Investitionen, die sich von der allgemeinen 25 %-igen Allokation des Fonds zu nachhaltigen Investitionen unterscheidet. Dieser Ansatz spiegelt die breitere ESG-Strategie des Fonds wider. Sie integriert sowohl ökologische als auch soziale Aspekte in ihre nachhaltigen Investitionskriterien, ohne jedoch die Allokation zwischen ökologischen und sozialen Zielen spezifisch aufzuschlüsseln oder sie an der EU-Taxonomie auszurichten.



Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen Teil seines Vermögens in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten sowie Derivaten halten, die nach dem Ermessen des Anlageverwalters zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden und die in der vorstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft werden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.



Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nein

Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?

k. A.

Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?

k. A.

Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?

k. A.

Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?

k. A.

Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?



Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:

Anlagen in SPDR Exchange Traded Funds (ETFs) (ssga.com)

2024 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten.

Der MSCI World Small Cap Index wurde von State Street Global Advisors Europe Limited als Referenzwert und/oder Referenzuniversum für die Auswahl der Unternehmen verwendet, die als Grundlage für den State Street Small Cap Enhanced Active Equity UCITS ETF dienen. MSCI sponsert, unterstützt, bewirbt oder empfiehlt den State Street World Small Cap Enhanced Active Equity UCITS ETF in keiner Weise. MSCI war und ist in keiner Weise an der Zusammenstellung, Berechnung, Pflege oder Überprüfung des State Street World Small Cap Enhanced Active Equity UCITS ETF beteiligt. Der MSCI World Small Cap Index wurde „ohne Gewähr“ zur Verfügung gestellt. MSCI, alle seine verbundenen Unternehmen und alle anderen Personen, die an der Zusammenstellung, Berechnung oder Schaffung des MSCI World Small Cap Index beteiligt oder damit verbunden sind (zusammenfassend die „MSCI-Parteien“), lehnen ausdrücklich jegliche Gewährleistungen ab (insbesondere Gewährleistungen hinsichtlich Echtheit, Richtigkeit, Vollständigkeit, Aktualität, Nichtverletzung von Rechten Dritter, Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck). Unbeschadet des Vorstehenden haften die MSCI-Parteien in keinem Fall für unmittelbare, mittelbare, konkrete oder beiläufige Schäden, Strafe einschließenden Schadenersatz oder Folgeschäden (insbesondere entgangene Gewinne) oder sonstige Schäden im Zusammenhang mit dem MSCI World Small Cap Index oder dem State Street World Small Cap Enhanced Active Equity UCITS ETF.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von MSCI Limited: MSCI World Small Cap Index.

Zum Datum des Nachtrags ist kein Unternehmen von MSCI Limited im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. MSCI Limited ist und bleibt von der britischen Finanzaufsicht (Financial Conduct Authority; „FCA“) als britischer Benchmark-Administrator zugelassen und reguliert (und ist im Finanzdienstleistungsregister der FCA (Financial Services Register) zu finden); MSCI Limited wird jedoch in Bezug auf die EU als in einem Drittstaat angesiedelter britischer Administrator betrachtet und wird gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung nicht im ESMA-Register eingetragen, sofern nicht und bis die EU eine Äquivalenzentscheidung bezogen auf das Vereinigte Königreich trifft oder bis MSCI der Status „Übernahme“ oder „Anerkennung“ gewährt wird.

State Street All World Enhanced Active Equity UCITS ETF

Nachtrag Nr. 75

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe I plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 19. Februar 2026 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag sollte zusammen mit dem Prospekt und dem Basisinformationsblatt für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte („PRIIPs-KID“) oder den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) gelesen werden. Er enthält Informationen über den State Street All World Enhanced Active Equity UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie State Street All World Enhanced Active Equity UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Der Fonds ist ein aktiv verwalteter Fonds.

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und das PRIIP-KID oder die KIID aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Untermanager	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	Bei ausschüttenden Anteilsklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Juni und Dezember), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten. Bei thesaurierenden Anteilsklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilsklassen.
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel-8-Fonds, bezieht Nachhaltigkeitsrisiken ein.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag. Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit) Die Verwaltungsgesellschaft kann nach ihrem Ermessen nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.
Abrechnungszeitpunkt	Für Zeichnungen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am zweiten Geschäftstag nach dem Handelstag, für Rücknahmen 15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem früheren oder späteren Zeitpunkt, der von der Verwaltungsgesellschaft bestimmt oder mit dieser vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer NIW	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	MSCI ACWI Index (NDUEACWF).
Zusätzliche Angaben zum Index	Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter: http://www.msci.com/products/indices/licensing/constituents.html http://www.msci.com/resources/factsheets/index_fact_sheet/msci-acwi-net.pdf

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Anteilsklassen

Art der Anteilsklasse	USD nicht abgesichert	
Name	State Street All World Enhanced Active Equity UCITS ETF	
Ausschüttungspolitik*	Dist	Acc
Währung der Anteilsklasse	USD	
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „ Gebühren und Kosten “ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,30 %	

*Ausschüttungspolitik: „Dist“ = Ausschüttende Anteile, „Acc“ = Thesaurierende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Ziel des Fonds ist es, eine Rendite zu erzielen, die über der Performance der Aktienmärkte in Industrie- und Schwellenländern weltweit liegt.

Anlagepolitik: Der Fonds wird (bezogen auf den Index) aktiv verwaltet. Die Anlagepolitik des Fonds zielt darauf ab, mittel- und langfristig eine Outperformance des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) zu erzielen. Die Anlagepolitik beinhaltet zudem den Ausschluss von Wertpapieren auf Basis einer Beurteilung ihrer Einhaltung bestimmter ESG-Kriterien, die vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegt werden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter verfolgen eine aktive Anlagestrategie, die auf einem eigenen quantitativen Multi-Faktor-Modell zur Aktienauswahl („Alpha-Modell“) des Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters basiert und zur Beurteilung der Attraktivität von Aktien eingesetzt wird. Dieses Alpha-Modell generiert Renditeprognosen für Aktien. Das Modell basiert auf einer relativen Bewertung jeder Aktie hinsichtlich Qualität, Wert und Stimmung. Das Modell nutzt die natürliche Sprachverarbeitung zur Analyse von Ereignissen oder Nachrichten, die zu Kursbewegungen einer Aktie führen können. Darüber hinaus bewertet das Alpha-Modell die Renditeerwartungen hinsichtlich Sektoren und Länder und beinhaltet eine dynamische Komponente, die sowohl auf titelspezifischen (Bottom-up) als auch auf makroökonomischen (Top-down) Inputs basiert. Bei der Zusammenstellung des Portfolios sind der Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter bemüht, Rendite- und Risikoerwartungen gegeneinander abzuwägen. Zu den definierten Risikoparametern gehören Beschränkungen hinsichtlich der Gewichtung von Ländern, Sektoren und Wertpapieren auf absoluter Basis und im Verhältnis zum Index. Die Performance des Fonds wird gegenüber dem Index gemessen. Da der Fonds aktiv verwaltet wird und eine Outperformance gegenüber dem Index anstrebt, unterscheiden sich seine Bestände von denen des Index. Der Anlageverwalter berücksichtigt in seinem Anlageprozess ESG-Kriterien.

Während die meisten Wertpapiere des Fonds in erster Linie Komponenten des Index sind, können die Gewichtungen der Fondsbeteiligungen von den Indexgewichtungen abweichen, um den Fonds bei der Erreichung seines Anlageziels – die Outperformance des Index – zu unterstützen. Der Fonds kann außerdem Wertpapiere halten, die nicht Teil des Index sind, aber ihren Sitz in Ländern haben, die im Index vertreten sind. Die erwartete Allokation von Vermögenswerten in Schwellenländern liegt zwischen 5 % und 15 % des Nettoinventarwerts des Fonds. Weitere Angaben zu den Arten von Wertpapieren, in die der Fonds investiert, entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Zugelassene Anlagen“ weiter unten. Die Gewichtung der Wertpapiere im Fonds unterscheidet sich zwar von der Gewichtung des Index, doch wird sie für gewöhnlich unter Bezugnahme auf die Gewichtung der Wertpapiere im Index festgelegt. Die Rendite des Fonds weicht in der Regel von derjenigen des Index ab und kann hinter dieser zurückbleiben.

Der Index misst die Wertentwicklung der globalen Aktienmärkte und erfasst Aktien aus Industrie- und Schwellenländern. Die Wertpapiere sind nach Marktkapitalisierung gewichtet. Indexkomponenten können

von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Wenngleich der Fonds aufgrund der sich verändernden Volatilität und Renditemerkmale der Aktienmärkte in Industrie- und Schwellenländern weltweit keine absolute Zielrendite und/oder Überrendite gegenüber dem Index anstrebt, wird unter normalen Marktbedingungen in der Regel von einer Rendite oberhalb des Index (nach Abzug von Gebühren und Kosten) bei einem vergleichbaren Risikoprofil ausgegangen. Es besteht die Möglichkeit, dass der Fonds den Index nicht übertrifft oder lediglich verhältnismäßig geringe Nettoerrenditen oberhalb des Index erzielt.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter berücksichtigt bei seinen Anlageentscheidungen Nachhaltigkeitsrisiken und wendet vor der Zusammenstellung des Fondsportfolios sowie fortlaufend einen negativen und normbasierten ESG-Filter an. Das normbasierte Screening bezeichnet den Ausschluss von Wertpapieren, die von Unternehmen emittiert werden, die gemäß dem Research des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters als gegen internationale Normen verstoßend befunden werden, beispielsweise in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsrichtlinien und Antikorruption.

Dieser Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 SFDR. Zu den von dem Fonds beworbenen ökologischen Merkmalen gehört die Verringerung des ökologischen Fußabdrucks und negativer sozialer Auswirkungen, indem Investitionen in Unternehmen, die in den Bereichen Kraftwerkskohle, Öl- und Gasförderung in der Arktis, Ölsandgewinnung tätig sind, ebenso ausgeschlossen werden wie Unternehmen, die in schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind und Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („UNGC-Grundsätze“) in Bezug auf die Umwelt verstoßen. Für bestimmte Branchen wendet der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter maximale prozentuale Schwellenwerte an, die in der Regel auf den Einnahmen aus der Produktion und/oder dem Vertrieb basieren. (Diese können variieren, je nachdem, ob es sich bei dem Emittenten um einen Produzenten, einen Vertreiber oder einen Dienstleister handelt.)

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter betrachtet ESG-Kontroversen als schwerwiegend, wenn Unternehmen in Vorfälle/Ereignisse verwickelt sind, die aufgrund ihrer potenziellen Auswirkungen auf Stakeholder, die Umwelt oder die Geschäftstätigkeit des Unternehmens ein Risiko für die Geschäftstätigkeit oder die Reputation darstellen können. Zu den mit dem Fonds beworbenen sozialen Merkmalen gehören: (a) die Verringerung der Verfügbarkeit von Waffen durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die mit kontroversen Waffen und zivilen Feuerwaffen in Verbindung stehen, (b) die Verringerung gesundheitsschädlicher Auswirkungen durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die mit Tabak in Verbindung stehen, und (c) die Unterstützung von Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die gegen die Grundsätze des UN Global Compact, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung verstoßen, sowie den Ausschluss von Unternehmen, die mit schwerwiegenden ESG-

Kontroversen in Verbindung stehen. Weitere Informationen über die ökologischen und sozialen Merkmale sind dem diesem Nachtrags beigefügten SFDR-Anhang zu entnehmen.

Bei der Auswahl der Anlagen wird der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter Wertpapiere von Unternehmen ausschließen, die als nicht konform mit den UNGC-Grundsätzen in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsrichtlinien, Korruptionsbekämpfung und umstrittene Waffen identifiziert werden. Darüber hinaus wird er Wertpapiere von Unternehmen ausschließen, die mit Kraftwerkskohle, Bohrungen in der Arktis, Öl- und Teersanden, Tabak und zivilen Schusswaffen in Verbindung stehen oder in schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind. Der Anlageverwalter kann jeweils zusätzliche ESG-Filter (Screens) anwenden, um Wertpapiere von Unternehmen auszuschließen, die an Tätigkeiten beteiligt sind, die als nicht konform mit einem oder mehreren der im vorstehenden Satz genannten ESG-Kriterien angesehen werden. Die spezifische Liste der anwendbaren Ausschlüsse kann sich weiterentwickeln und, sofern die Anforderungen der Zentralbank erfüllt werden, jeweils vom Anlageverwalter geändert werden. Soweit eine solche Korrektur zu einer Änderung der Art und Weise führt, wie die Anlagepolitik umgesetzt oder in diesem Nachtrag beschrieben wird, werden die Anteilinhaber gemäß den Anforderungen der Zentralbank benachrichtigt und der Nachtrag entsprechend auf den neuesten Stand gebracht.

Taxonomie-Verordnung: Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Teilfonds zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Der Fonds ist nicht verpflichtet, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in taxonomiekonforme Anlagen zu investieren. Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depositary Receipts (ADR) oder Global Depositary Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die lokalen Aktien zu erwerben. Der Fonds kann auch über Stock Connect oder unter Nutzung des QFI-Status des Anlageverwalters oder Unteranlageverwalters in chinesischen A-Aktien anlegen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann zu Zwecken des effizienten Portfoliomanagements oder zu Absicherungszwecken derivative Finanzinstrumente einsetzen („DFI“). Der Einsatz von DFI beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte, einschließlich Non-Deliverable Forwards. Effizientes Portfoliomanagement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass die Fondsrendite vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt **„Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“** des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Der Fonds beabsichtigt nicht, sich an einem Wertpapierleihprogramm zu beteiligen, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt.

Bitte beachten Sie, dass die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert wird, sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung der Wertpapierleihpolitik des Fonds beschließen.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt **„Risikoinformationen“** im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Aktives Risiko: Die Anlagerendite entspricht in der Regel nicht der des Index. Anlageentscheidungen des Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters, Wertpapiere des Index unter- oder überzugewichten oder die Anlagen im Fonds gegenüber den Indexkomponenten zu variieren, einschließlich in Bezug auf bestimmte Wertpapiere oder breitere Anlagesektoren, haben Einfluss auf die Wertentwicklung des Fonds im Vergleich zum Index. Darüber hinaus wird die Wertentwicklung des Fonds im Vergleich zum Index durch Kosten des Fonds, den Bestand an liquiden Mitteln im Fonds sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeteiligungen beeinflusst.

Managementrisiko: Der Fonds wird aktiv verwaltet. Die Einschätzung des Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters hinsichtlich der Attraktivität, des relativen Werts oder einer potenziellen Wertsteigerung eines bestimmten Sektors, eines Wertpapiers, eines Rohstoffs oder einer Anlagestrategie kann sich als falsch erweisen und zu Verlusten für den Fonds führen. Es kann nicht garantiert werden, dass die Anlagetechniken und -entscheidungen des Anlageverwalters zu den gewünschten Ergebnissen führen.

Modellrisiko: Der Anlageverwalter verwendet zur Renditesteigerung und zum Risikomanagement quantitative Modelle. Unvollkommenheiten, Fehler oder Einschränkungen in diesen Modellen oder ihrer Programmierung könnten den Nutzen, den der Fonds aus

der Verwendung der Modelle zieht, einschränken und zu falschen Ergebnissen oder zu Anlageergebnissen führen, die nicht den vom Anlageverwalter erwarteten oder erwünschten Anlageergebnissen entsprechen. Derlei Unvollkommenheiten, Fehler oder Einschränkungen werden möglicherweise nie oder erst dann entdeckt, wenn ein Fonds bereits einen Verlust erlitten (oder eine geringere Performance erzielt) hat. Ferner kann nicht garantiert werden, dass sich die Modelle unter allen Marktbedingungen wie erwartet verhalten werden.

Screening-Risiken: Es besteht ein Risiko von Fehlern seitens des Erbringers von Screening-Diensten, etwa eine falsche Beurteilung der Screening-Kriterien und/oder die Aufnahme der falschen/der Ausschluss der richtigen Komponenten im Screening-Prozess oder die Einstellung seiner Screening-Dienste. In einer solchen Situation kann die Gesellschaft einen anderen Erbringer von Screening-Diensten bestellen, obwohl es keine Garantie dafür gibt, dass ein ersetzendes Screening zu einem ähnlichen Filterverfahren wie dem Vorgesehenen führen würde oder überhaupt verfügbar wäre.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhten Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Schwellenländerrisiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe.

Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in der Volksrepublik China: Neben den Risiken von Anlagen in Schwellenländern zählen zu den Risiken von Anlagen in der VRC unter anderem Handelsaussetzungen, Beschränkungen von Währungstransfers/-engagements, Grenzen für das Halten von Anlagen in der VRC und die Inanspruchnahme von Maklern, nicht erprobte Konzepte für die Handhabung des wirtschaftlichen Eigentums, die Abhängigkeit von Zugangsprogrammen, die eingestellt oder wesentlich verändert werden können, technologische Systemrisiken und Kontrollen im Zusammenhang mit solchen Zugangsprogrammen, Verwahrstellenrisiken, einschließlich einer mangelnden Trennung der Vermögenswerte des Antragstellers und anderer

Intermediäre im Rahmen der betreffenden Zugangsprogramme und der betreffenden Unterdepotbanken, sowie steuerliche Unsicherheiten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements oder zu Absicherungszwecken einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Risiko im Zusammenhang mit Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren: Die Marktkurse von Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren können steigen oder fallen, manchmal schnell und unvorhersehbar. Der Wert dieser Wertpapiere kann aus Gründen fallen, die direkt mit dem Emittenten zusammenhängen und/oder aufgrund von allgemeinen Branchen- oder Marktbedingungen, wie z. B. tatsächlichen oder wahrgenommenen widrigen Wirtschaftsbedingungen, Veränderungen im allgemeinen Ausblick für Unternehmensgewinne, Zins- oder Wechselkursänderungen oder einer allgemein negativen Anlegerstimmung. Aktienmärkte bewegen sich zyklisch. Das kann dazu führen, dass Aktienkurse über kürzere oder längere Zeiträume fallen.

Einbeziehung von ESG: Die Einbeziehung von ESG bezeichnet die Einbeziehung qualitativer und quantitativer ESG-Informationen in den Anlageprozess, einschließlich Nachhaltigkeitsrisiken, und soll Anlageentscheidungen optimieren. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter integriert ESG-Kriterien, um die finanzielle Performance zu verbessern und/oder finanzielle Risiken zu mindern. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter berücksichtigt ESG-Faktoren explizit und systematisch in der Anlageanalyse und den Anlageentscheidungen, um die Risiken zu senken und Erträge zu generieren. Die Einbeziehung von ESG ist ein breit angelegtes Instrument, bei dem wesentliche ESG-Komponenten als Risiko- und/oder Renditetreiber betrachtet werden und nicht als Mittel, um bestimmte ökologische, soziale und/oder die Unternehmensführung betreffende Ziele zu erreichen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter wird beurteilen, ob und wie finanziell wesentliche ESG-Themen in seine Entscheidungsprozesse integriert werden, er wird angemessene ESG-Signale und -Faktoren zur Risikominderung berücksichtigen und Chancen für das langfristige Performancepotenzial ermitteln.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken in den Anlageprozess des Fonds garantiert nicht die Minderung aller oder einzelner Nachhaltigkeitsrisiken. Der Anlageverwalter hat die wahrscheinlichen Auswirkungen von Nachhaltigkeitsrisiken auf die Renditen des Fonds bewertet. Dabei kam er zu dem Schluss, dass Nachhaltigkeitsrisiken die Volatilität des Fonds erhöhen und / oder bereits bestehende Risiken für den Fonds verstärken können, dies aber voraussichtlich nicht tun, und dass sich diese erheblich negativ auf den Wert des Portfolios auswirken können. Nachhaltigkeitsrisiken können besonders akut sein, wenn sie unerwartet oder plötzlich auftreten. Derartige Risiken können einen weiteren Abwärtsdruck auf den Wert des Fonds ausüben und Anleger dazu veranlassen, ihre Anlage zu überdenken. Nachhaltigkeitsrisiken werden gemäß der oben unter „Anlagepolitik“ beschriebenen Anlagestrategie des Fonds in

die Anlageentscheidungen des Anlageverwalters einbezogen. So kann der Anlageverwalter beispielsweise versuchen, bestimmte Nachhaltigkeitsrisiken durch die Anwendung von ESG-Filtern und anderen Kriterien, wie in der Anlagepolitik beschrieben, zu mindern. Die Verpflichtung des Fonds, mindestens 25 % in nachhaltige Investitionen zu investieren, kann ebenfalls zu einer potenziellen Minderung des Nachhaltigkeitsrisikos beitragen, verglichen mit einer Situation, in der keine solche Verpflichtung eingegangen worden wäre.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko: Die SFDR erlegt den Teilnehmern an den Finanzmärkten neue Offenlegungspflichten auf. Zum Datum dieses Nachtrags wurden die technischen Regulierungsstandards zur Umsetzung (Stufe 2) für die SFDR von der Europäischen Kommission verabschiedet. Sie sind seit dem 1. Januar 2023 in Kraft, doch sind einige der von der SFDR eingeführten Konzepte derzeit nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Der Fonds wurde in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Nachtrag und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Informationen und Klassifizierungen gemäß Artikel 8 Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung von Large- und Mid-Cap-Aktien aus Industrie- und Schwellenländern weltweit suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Abgaben und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss beim Administrator eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerte durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 20. Februar 2026 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 19. August 2026 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „Erstausgabezeitraum“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 10 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Kosten und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren NIW ausgegeben.

SFDR-Anhang

Vorlage – Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der
Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten
Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: State Street All World Enhanced Active Equity UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung: 9845009J7A13F078A486

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☒ ☐ **Ja**

☒ ☐ ☒ **Nein**

☐ Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ____%

☒ Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 25 % an nachhaltigen Investitionen

☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☒ mit einem sozialen Ziel

☐ Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ____%

☐ Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Zu den mit dem Fonds beworbenen ökologischen Merkmalen gehören:

i) eine Verringerung des ökologischen Fußabdrucks und negativer sozialer Auswirkungen, indem Investitionen in Unternehmen, die in den Bereichen Kraftwerkskohle, Öl- und Gasexploration in der Arktis und Ölsandgewinnung tätig sind, ebenso ausgeschlossen werden wie Unternehmen, die in schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind und Unternehmen, die gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“) in Bezug auf die Umwelt (Grundsätze 7 bis 9) verstoßen.

Zu den mit dem Fonds beworbenen sozialen Merkmalen gehören:

i) eine Verringerung der Verfügbarkeit von Waffen durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die mit kontroversen Waffen und zivilen Feuerwaffen in Verbindung stehen;

ii) eine Verringerung gesundheitsschädlicher Auswirkungen durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die mit Tabak in Verbindung stehen; und

iii) die Unterstützung von Menschenrechten, Arbeitsnormen und Korruptionsbekämpfung durch den Ausschluss von Investitionen in Unternehmen, die gegen die UNGC-Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte (Grundsätze 1 und 2), Arbeit (Grundsätze 3 bis 6) und Korruptionsbekämpfung (Grundsatz 10) verstoßen, sowie in Unternehmen, die mit schwerwiegenden ESG-Kontroversen in Verbindung stehen.

Die UNGC-Grundsätze stehen für die weltweit größte Initiative für unternehmerische Nachhaltigkeit, die darauf abzielt, dass Unternehmen ihre Strategien und Tätigkeiten an universellen Grundsätzen zu

Menschenrechten, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung ausrichten und Maßnahmen ergreifen, die soziale Ziele fördern.

Geschäftliche Beteiligung: Die Definition von „beteiligt“ in Bezug auf jede der oben genannten Tätigkeiten wird anhand der firmeneigenen Methode des Anlageverwalters festgelegt. Jede Tätigkeit kann auf der Erwirtschaftung oder Ableitung von Umsätzen aus der Tätigkeit beruhen, die einen prozentualen Umsatzanteil oder eine festgelegte Gesamtumsatzschwelle übersteigt, oder auf einem Engagement in der Tätigkeit, ungeachtet der Höhe der vereinnahmten Umsätze. Gemäß der firmeneigenen Methode des Anlageverwalters kann sich die Tätigkeit auf die Produktion oder den Vertrieb oder beides beziehen. Für bestimmte Branchen wendet der Anlageverwalter maximale prozentuale Schwellenwerte an, die in der Regel auf den Einnahmen aus Produktion und/oder dem Vertrieb basieren. (Diese können variieren, je nachdem, ob es sich bei dem Emittenten um einen Produzenten, einen Vertrieber oder einen Dienstleister handelt), wie nachstehend aufgeführt:

Kraftwerkskohle	Förderung und/oder Verstromung, Höhe der Beteiligung $\geq 10\%$
Arktisches Öl & Gas	Förderung, Höhe der Beteiligung $\geq 10\%$
Ölsand	Gewinnung, Höhe der Beteiligung $\geq 10\%$
schwerwiegende ESG-Kontroversen	Kategorie 5 — schwerwiegende Kontroversen
Grundsätze des UN Global Compact	Verstöße gegen die Grundsätze des Global Compact = Nicht konform
Kontroverse Waffen	Herstellung und Wartung von Kernwaffensystemen oder -komponenten. Höhe der Beteiligung = „True“ oder $\geq 10\%$
Zivile Feuerwaffen	Herstellung und/oder Verkauf von Kleinwaffen und der dazugehörigen Munition/den Komponenten für zivile Zwecke. Höhe der Beteiligung $\geq 10\%$
Tabak	Produktion und Herstellung von Tabak und tabakbezogenen Produkten, Höhe der Beteiligung $\geq 10\%$

Die spezifische Liste der anwendbaren Ausschlüsse kann sich weiterentwickeln und, sofern die Anforderungen der Zentralbank erfüllt werden, jeweils vom Anlageverwalter geändert werden.

Weitere Einzelheiten zu den Ausschlusskriterien, die der Anlageverwalter zu jeder Zeit zwecks der Bewerbung ökologischer und/oder sozialer Merkmale anwendet, sowie die Definitionen der Begriffe „beteiligt“, „Beteiligung“ und „in Verbindung“ sowie die Schwellenwerte und Kriterien, die bei der Bewertung der oben genannten Umsätze und Geschäftsbeteiligungen angewendet werden, finden Sie unter dem folgenden Link: https://www.ssga.com/ie/en_gb/institutional/fund-finder?tab=documents&type=uk-etfs

Der Fonds legt mindestens 25 % seines Portfolios in nachhaltigen Investitionen an. Damit das Wertpapier als nachhaltige Anlage für den Fonds in Frage kommt, muss es vom Anlageverwalter anhand des Nachhaltigkeitsratings (anhand seines firmeneigenen Verfahrens zur Bewertung der Nachhaltigkeit, das „Nachhaltigkeitsrating“) als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden (siehe „Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?“).

Es wurde kein Referenzwert festgelegt, um die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen Merkmale wird gemessen anhand:

- des Prozentsatzes des Portfolios, der in Wertpapiere investiert ist, die gegen die UNGC-Grundsätze in Bezug auf die Umwelt verstoßen und die in den Bereichen Kraftwerkskohle, arktische Öl- und Gasförderung sowie Ölsandgewinnung tätig sind. Das Engagement in solchen Wertpapieren wird voraussichtlich bei 0 % des Anteils der Wertpapiere liegen, die die oben genannten Kriterien für eine geschäftliche Beteiligung erfüllen.

Die Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen Merkmale wird gemessen anhand:

- des Prozentsatzes des Portfolios, der in Wertpapiere investiert ist, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen, sowie in Unternehmen, die mit umstrittenen Waffen, zivilen Schusswaffen und Tabak in Verbindung stehen und solchen, die in

schwerwiegende ESG-Kontroversen verwickelt sind. Das Engagement in solchen Wertpapieren wird voraussichtlich bei 0 % des Anteils der Wertpapiere liegen, die die oben genannten Kriterien für eine geschäftliche Beteiligung erfüllen.

Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen erfolgen in Unternehmen, die nach Einschätzung des Anlageverwalters in einer wirtschaftlichen Tätigkeit operieren, die entweder zu einem ökologischen (z. B. THG-Emissionen, Wassermanagement und ökologische Auswirkungen) oder sozialen (z. B. Menschenrechte und Mitarbeiterbindung, Vielfalt und Inklusion) Ziel beiträgt.

Der Anlageverwalter führt Analysen durch, um Unternehmen zu identifizieren, die zur Erreichung dieser ökologischen und/oder sozialen Ziele beitragen, indem er Daten von mehreren Anbietern von Nachhaltigkeitsdaten heranzieht, auf deren Grundlage er für jedes Wertpapier ein Nachhaltigkeitsrating erstellt.

Damit ein Wertpapier als nachhaltige Investition infrage kommt, muss es vom Anlageverwalter anhand des Nachhaltigkeitsratings (das anhand seines hausinternen Nachhaltigkeitsbewertungsverfahrens erstellt wird) als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden (das „**Nachhaltigkeitsrating**“). Ein „Vorreiter“ oder „Outperformer“ ist als ein Wertpapier definiert, das im besten 30. Perzentil des Nachhaltigkeitsuniversums des Anlageverwalters liegt, wie von ihm anhand des durch den firmeneigenen Prozess generierten Nachhaltigkeitsratings ermittelt.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden sollen, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nachhaltige Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden, sollten ökologisch oder sozial nachhaltige Investitionsziele nicht erheblich beeinträchtigen. In dieser Hinsicht berücksichtigt der Anlageverwalter die verbindlichen Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („**PAIs**“), wie in Tabelle 1, Anhang 1 der Stufe 2 der SFDR zu Nachhaltigkeitsfaktoren festgelegt, d. h. durch die Einbeziehung des Wesentlichkeitsrahmens des SASB in das Nachhaltigkeitsrating des Anlageverwalters und die Anwendung der oben dargelegten Ausschlüsse. Durch die Anlage in Wertpapieren, die gemäß dem firmeneigenen Nachhaltigkeitsrating des Anlageverwalters als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden, und die Anwendung von Ausschlüssen im Index ist der Anlageverwalter der Ansicht, dass die nachhaltigen Investitionen des Fonds kein ökologisch oder sozial nachhaltiges Investitionsziel erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die verbindlichen PAIs werden sowohl durch die Einbeziehung des Wesentlichkeitsrahmens des SASB in das firmeneigene Nachhaltigkeitsrating des Anlageverwalters als auch durch die Anwendung der negativen und normenbasierten Filter in den Kriterien berücksichtigt, die der Anlageverwalter für ein Wertpapier entwickelt hat, um als nachhaltige Investition betrachtet zu werden. So werden Investitionen ausgeschlossen, die als ein ökologisch oder sozial nachhaltiges Investitionsziel beeinträchtigend gelten. Normbasiertes Screening bezeichnet den Ausschluss von Wertpapieren, die von Unternehmen emittiert wurden, die im Anschluss an Research als gegen internationale Normen in Bezug auf beispielsweise Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsrichtlinien und Antikorruption verstoßend befunden wurden. Ein Beispiel für einen negativen Filter ist der Ausschluss von Wertpapieren, die von Unternehmen emittiert wurden, die nach Research als im Bereich von kontroversen Waffen gemäß Festlegung im Übereinkommen über Streumunition tätig befunden wurden, und/oder die Ausschlüsse von Unternehmen auf der Grundlage anderer ESG-Kriterien wie etwa die ESG-Ratingschwellen.

Unternehmen, die im Rahmen des firmeneigenen Nachhaltigkeitsratings des Anlageverwalters, der auf dem Wesentlichkeitsrahmen des SASB basiert, als „Vorreiter“ oder „Outperformer“ eingestuft werden und die nicht durch die negativen und normenbasierten Filter ausgeschlossen werden, gelten als nachhaltige Investitionen und stellen daher keine erhebliche Beeinträchtigung eines ökologisch oder sozial nachhaltigen Investitionsziels dar. Die vorab festgelegten negativen und

normenbasierten Filter werden eingesetzt, damit Unternehmen, die als nicht konform mit den Grundsätzen des UNGC (in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsnormen, Korruptionsbekämpfung) eingestuft werden, sowie ebenfalls Unternehmen, die mit schwerwiegenden ESG-Kontroversen, umstrittenen Waffen, zivilen Schusswaffen, Kraftwerkskohle, Öl- und Gasexploration in der Arktis sowie Ölsandgewinnung und Tabak in Verbindung gebracht werden, nicht als nachhaltige Investitionen betrachtet werden.

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Eine nachhaltige Investition, wie vom Anlageverwalter festgelegt, schließt keine Unternehmen ein, die nach Auffassung des Anlageverwalters gegen die Grundsätze des UNGC verstoßen. Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte werden bei der Bewertung der Grundsätze des United Nations Global Compact berücksichtigt.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?



Ja,

Der Fonds strebt nach einer Reduzierung der durch die zugrunde liegenden Investitionen verursachten negativen externen Effekte. Dabei berücksichtigt er als Teil der Prüfung der nachhaltigen Investitionen bei der Auswahl der Wertpapiere für den Fonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („PAIs“) zu Nachhaltigkeitsfaktoren und wendet zudem negative und normbasierte ESG-Filter vor der Zusammenstellung des Portfolios an. Der Fonds berücksichtigt insbesondere:

- Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind
- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze
- Engagement in umstrittenen Waffen

Weitere Informationen zu den PAI finden Sie in den regelmäßigen Fondsberichten.

Nein



Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter verfolgen eine aktive Anlagestrategie, die auf einem eigenen quantitativen Multi-Faktor-Modell zur Aktienausswahl („Alpha-Modell“) des Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters basiert und zur Beurteilung der Attraktivität von Aktien eingesetzt wird. Dieses Alpha-Modell generiert Renditeprognosen für Aktien. Das Modell basiert auf einer relativen Bewertung jeder Aktie hinsichtlich Qualität, Wert und Stimmung. Das Modell nutzt die natürliche Sprachverarbeitung zur Analyse von Ereignissen oder Nachrichten, die zu Kursbewegungen einer Aktie führen können. Darüber hinaus bewertet das Alpha-Modell die Renditeerwartungen hinsichtlich Sektoren und Länder und beinhaltet eine dynamische Komponente, die sowohl auf titelspezifischen (Bottom-up) als auch auf makroökonomischen (Top-down) Inputs basiert. Bei der Zusammenstellung des Portfolios sind der Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter bemüht, Rendite- und Risikoerwartungen gegeneinander abzuwägen. Zu den definierten Risikoparametern gehören Beschränkungen hinsichtlich der Gewichtung von Ländern, Sektoren und Wertpapieren auf absoluter Basis und im Verhältnis zum Index.

Im Rahmen dieser Strategie können der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter in Wertpapiere investieren oder Engagements eingehen, die an anderen Märkten als den im Index enthaltenen registriert sind oder gehandelt werden. Bei der Umsetzung dieser Strategie wendet der Anlageverwalter vor der Zusammenstellung des Fondsportfolios und fortlaufend einen negativen und normbasierten ESG-Filter an. Der Fonds schließt Wertpapiere von Emittenten aus, die die UNGC-Grundsätze in Bezug auf Umweltschutz, Menschenrechte, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung nicht einhalten oder mit schwerwiegenden ESG-Kontroversen, kontroversen Waffen, zivilen Feuerwaffen, Tabak, Kraftwerkskohle, Öl- und Gasförderung in der Arktis und Ölsandgewinnung in Verbindung stehen.

Der Fonds kann jeweils zusätzliche ESG-Filter anwenden, um Wertpapiere von Unternehmen auszuschließen, die an Tätigkeiten beteiligt sind, die als nicht konform mit einem oder mehreren der im vorstehenden Absatz genannten ESG-Kriterien angesehen werden.

Die Anlagestrategie dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Um die mit dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, wendet der Anlageverwalter vor der Zusammenstellung des Portfolios und fortlaufend, wie im vorigen Abschnitt beschrieben, einen negativen und normbasierten ESG-Filter an (wie oben beschrieben).

Die vorstehende Liste ist ein nicht erschöpfendes Verzeichnis der Ausschlusskriterien, und der Anlageverwalter kann jeweils zusätzliche ESG-Filter anwenden, um Wertpapiere aus dem Portfolio auszuschließen, wenn sie nach seinem Ermessen eines oder mehrere der von ihm festgelegten ESG-Kriterien nicht erfüllen.

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

k. A.

Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?

Die Beurteilung der Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung erfolgt über das vom Fonds angewandte Negativ-Screening. Unternehmen, die nach Einschätzung des Anlageverwalters nicht gegen die UNGC-Grundsätzen verstoßen, gelten als eine gute Unternehmensführung aufweisend.

Die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

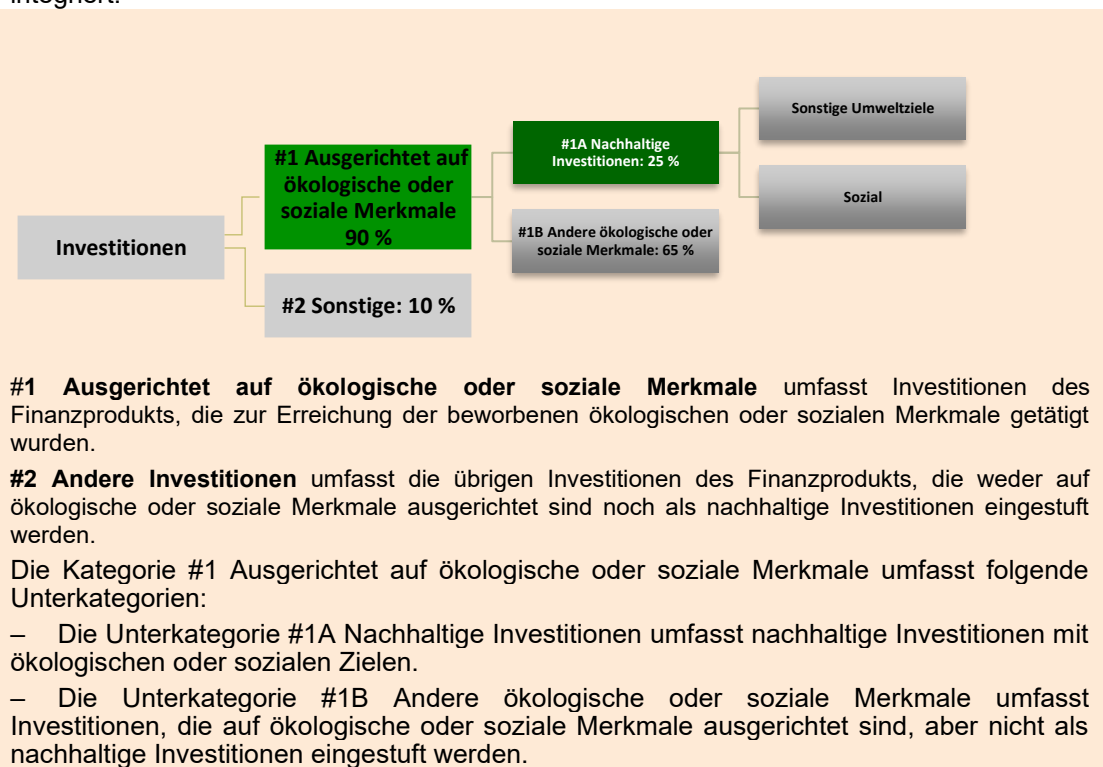
Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Der Anlageverwalter verwendet eine verbindliche ESG-Methode, die den Aufbau eines Portfolios verfolgt, in dem mindestens 90 % des Fondsvermögens in Wertpapieren investiert sind, die unter „#1 Ausgerichtet auf ökologische und soziale Merkmale“ fallen, wie in nachstehender Tabelle angegeben. Es ist beabsichtigt, dass innerhalb dieses Teils des Portfolios mindestens 25 % des Fondsvermögens in Wertpapiere investiert werden, bei denen es sich um nachhaltige Investitionen mit ökologischen und/oder sozialen Zielen handelt. Der verbleibende Teil (<10 %) des Portfolios, bestehend aus sowohl Zahlungsmitteln als auch Zahlungsmitteläquivalenten, einschließlich derivativer Finanzinstrumente, die zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements oder zu Absicherungszwecken eingesetzt werden und nach Ermessen des Anlageverwalters gehalten werden, wird in der nachstehenden Tabelle unter „#2 Andere Investitionen“ klassifiziert, ist nicht auf die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet.

Der Fonds verpflichtet sich nicht ausdrücklich zu einer separaten Allokation in sozial nachhaltigen Investitionen, die sich von ökologisch nachhaltigen Investitionen unterscheiden. Dieser Ansatz spiegelt die breitere ESG-Strategie des Fonds wider, die sowohl ökologische als auch soziale Überlegungen in ihre nachhaltigen Investitionskriterien integriert.



Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Soweit der Fonds ausschließlich zum Zweck des effizienten Portfoliomanagements oder zu Absicherungszwecken derivative Finanzinstrumente einsetzt, werden diese nicht zur Erreichung der mit dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Daher verpflichtet sich der Fonds nicht, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in Anlagen zu investieren, die der Taxonomie-Verordnung entsprechen. Daher ist zu beachten, dass dieser Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Taxonomie-Verordnung nicht berücksichtigt. Es ist daher keine Ausrichtung des Portfolios an der Taxonomie-Verordnung geplant.

Es ist keine Ausrichtung an der Taxonomie-Verordnung beabsichtigt.

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹



Ja:



In fossiles Gas



In Kernenergie



Nein

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Da sich der Fonds nicht verpflichtet, in „ökologisch nachhaltige Investitionen“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung zu investieren, wurde der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten deshalb auch mit 0 % angesetzt.



Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Fonds beabsichtigt, mindestens 0 % seines Vermögens in nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel zu investieren, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind. Die Festlegung der Bewertung der Fondsinvestitionen, die als nachhaltig eingestuft werden, erfolgt in der Regel monatlich, wenn die ESG-Bewertungen aktualisiert werden.



sind

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Fonds beabsichtigt, mindestens 0 % seines Vermögens in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind. Die Festlegung der Bewertung der Fondsinvestitionen, die als nachhaltig eingestuft werden, erfolgt in der Regel monatlich, wenn die ESG-Bewertungen aktualisiert werden.

Während der Fonds sich zwar zu 25 % an nachhaltigen Investitionen verpflichtet, besteht keine ausdrückliche Verpflichtung zu einer separaten Allokation in sozial/ökologisch nachhaltigen Investitionen, die sich von der allgemeinen 25 %-igen Allokation des Fonds zu nachhaltigen Investitionen unterscheidet. Dieser Ansatz spiegelt die breitere ESG-Strategie des Fonds wider. Sie integriert sowohl ökologische als auch soziale Aspekte in ihre nachhaltigen Investitionskriterien, ohne jedoch die Allokation zwischen ökologischen und sozialen Zielen spezifisch aufzuschlüsseln oder sie an der EU-Taxonomie auszurichten.



Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen Teil seines Vermögens in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten sowie Derivaten halten, die nach dem Ermessen des Anlageverwalters zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden und die in der vorstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft werden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.



Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nein

Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?

k. A.

Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?

k. A.

Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?

k. A.

Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?

k. A.

Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:
Anlagen in SPDR Exchange Traded Funds (ETFs) (ssga.com)



Der MSCI ACWI Index wurde von State Street Global Advisors Europe Limited als Referenzwert und/oder Referenzuniversum für die Auswahl der Unternehmen verwendet, die als Grundlage für den State Street All World Enhanced Active Equity UCITS ETF dienen. MSCI sponsert, unterstützt, bewirbt oder empfiehlt den State Street All World Enhanced Active Equity UCITS ETF in keiner Weise. MSCI war und ist in keiner Weise an der Zusammenstellung, Berechnung, Pflege oder Überprüfung des State Street All World Enhanced Active Equity UCITS ETF beteiligt. Der MSCI ACWI Index wurde „ohne Gewähr“ zur Verfügung gestellt. MSCI, alle seine verbundenen Unternehmen und alle anderen Personen, die an der Zusammenstellung, Berechnung oder Schaffung des MSCI ACWI Index beteiligt oder damit verbunden sind (zusammenfassend die „MSCI-Parteien“), lehnen ausdrücklich jegliche Gewährleistungen ab (insbesondere Gewährleistungen hinsichtlich Echtheit, Richtigkeit, Vollständigkeit, Aktualität, Nichtverletzung von Rechten Dritter, Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck). Unbeschadet des Vorstehenden haften die MSCI-Parteien in keinem Fall für unmittelbare, mittelbare, konkrete oder beiläufige Schäden, Strafe einschließenden Schadenersatz oder Folgeschäden (insbesondere entgangene Gewinne) oder sonstige Schäden im Zusammenhang mit dem MSCI ACWI Index oder dem State Street All World Enhanced Active Equity UCITS ETF.

Zum Datum des Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von MSCI Limited: MSCI ACWI Index.

Zum Datum des Nachtrags ist kein Unternehmen von MSCI Limited im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. MSCI Limited ist und bleibt von der britischen Finanzaufsicht (Financial Conduct Authority; „FCA“) als britischer Benchmark-Administrator zugelassen und reguliert (und ist im Finanzdienstleistungsregister der FCA (Financial Services Register) zu finden); MSCI Limited wird jedoch in Bezug auf die EU als in einem Drittstaat angesiedelter britischer Administrator betrachtet und wird gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung nicht im ESMA-Register eingetragen, sofern nicht und bis die EU eine Äquivalenzentscheidung bezogen auf das Vereinigte Königreich trifft oder bis MSCI der Status „Übernahme“ oder „Anerkennung“ gewährt wird.

**SSGA SPDR ETFs Europe I plc
(DIE „GESELLSCHAFT“)**

**LÄNDERNACHTRAG - ZUSÄTZLICHE INFORMATIONEN FÜR ANLEGER IN DER BUNDESREPUBLIK
DEUTSCHLAND**

Datum: 24. Februar 2026

Dieser Ländernachtrag ist Bestandteil des aktuellsten Prospekts der Gesellschaft in der jeweils geltenden Fassung und sollte im Zusammenhang mit diesem gelesen werden.

1. Rechtsgrundlage und Vertrieb in Deutschland

Dieses Dokument wird gemäß Artikel 92 der OGAW-Richtlinie (2009/65/EG), geändert durch die Richtlinie (EU) 2019/1160 im Hinblick auf den grenzüberschreitenden Vertrieb von Organismen für gemeinsame Anlagen (die „CBDF-Richtlinie“), und den einschlägigen Bestimmungen des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs („KAGB“) herausgegeben. Die Anteile der Gesellschaft wurden bei der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht („BaFin“) zum Vertrieb in Deutschland angezeigt.

2. Liste der Teilfonds, die nicht für den Vertrieb in Deutschland registriert sind

Für die folgenden Anlagezweige wurden keine Anzeigen zum Vertrieb in der Bundesrepublik Deutschland bei der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht („BaFin“) eingereicht, so dass Anteile an diesen Anlagezweigen nicht an Anleger im Geltungsbereich des Kapitalanlagegesetzbuchs („KAGB“) vertrieben werden dürfen:

1. SPDR STOXX Global Low Volatility UCITS ETF
2. SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF
3. SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF
4. SPDR Bloomberg EM Inflation Linked Local Bond UCITS ETF

3. Einrichtungen für Anleger in Deutschland

Gemäß Artikel 92 der OGAW-Richtlinie (in der durch die Richtlinie (EU) 2019/1160 geänderten Fassung) hat die Gesellschaft das folgende Unternehmen mit der Bereitstellung lokaler Anlegereinrichtungen in Deutschland beauftragt:

State Street Bank International GmbH
Hansastraße 59
81373 München, Deutschland
E-Mail: AFTclientserviceprojects@StateStreet.com

Der Facilities Agent stellt den lokalen Anlegern folgende Serviceleistungen zur Verfügung:

- Bearbeitung von Zeichnungen, Rücknahme- und Rückkaufaufträgen sowie Zahlungen an und von Anlegern bzgl. ihrer Anteile an der Gesellschaft;
- Bearbeitung von Anlegerbeschwerden und die Ermöglichung der Durchsetzung von Anlegerrechten gemäß den nationalen Gesetzen;
- Bereitstellung aller gesetzlich vorgeschriebenen Dokumente auf einem dauerhaften Datenträger, einschließlich des Prospekts, der PRIIPs-KIDs, der Satzung und der Finanzberichte;
- Funktion als Schnittstelle zwischen der Gesellschaft und der zuständigen Aufsichtsbehörde.

4. Zugang zu rechtlichen und regulatorischen Dokumenten

Die folgenden Dokumente sind kostenlos beim Facilities Agent und am eingetragenen Sitz der Gesellschaft erhältlich:

- Der Prospekt und seine Nachträge;
- Die aktuellen Basisinformationsblätter („PRIIPs-KIDs“);
- Die Gründungsurkunde und die Satzung;
- Jahres- und Halbjahresfinanzberichte.

Darüber hinaus können die Dokumente online abgerufen werden unter www.statestreet.com/im.

5. Veröffentlichung von Kursen und Mitteilungen an die Anteilinhaber

Der Nettoinventarwert (NIW) pro Anteil jedes Teilfonds wird täglich auf Bloomberg und auf der Website der Gesellschaft veröffentlicht. Mitteilungen an die Anteilinhaber werden gemäß den gesetzlichen Bestimmungen zur Verfügung gestellt. Der NIW und die Mitteilungen an die Anteilinhaber sind abrufbar unter www.statestreet.com/im.

6. Steuerinformationen für Deutschland

Bei den folgenden Informationen in diesem Abschnitt handelt es sich lediglich um einen allgemeinen Überblick über die Besteuerung von Anlegern, die steuerlich in Deutschland ansässig sind, d. h. in Deutschland unbeschränkt steuerpflichtig sind. Dieser Überblick ist nicht als eine erschöpfende oder vollständige Analyse aller relevanten steuerlichen Aspekte im

Zusammenhang mit der Anlage in Anteile durch die oben genannten deutschen Anleger zu verstehen und stellt keine Rechts- oder Steuerberatung für solche deutschen Anleger dar. Die Ausführungen beschränken sich auf bestimmte Aspekte des aktuellen deutschen Steuerrechts und treffen unter Umständen nicht auf alle Arten von deutschen Anlegern zu. Die Richtigkeit dieser Informationen kann nicht garantiert werden, und die Ausführungen sollen keinesfalls einen Ersatz für eine detaillierte professionelle Steuerberatung darstellen, die ein Anleger in Anspruch nehmen könnte. Die Informationen basieren auf einer Auslegung der Gesetze und der Ansichten der deutschen Steuerbehörden zum Zeitpunkt der Veröffentlichung des Prospekts. Da nicht ausgeschlossen werden kann, dass zwischen diesem Datum und dem Datum der letztendlichen Anlageentscheidung eines Anlegers sich die steuerliche Situation oder die Ansichten der deutschen Steuerbehörden geändert haben könnten, sind die Anleger gehalten, die steuerlichen Folgen einer Anlage abzuschätzen und gegebenenfalls professionelle Beratung in Anspruch zu nehmen. Deutsche Anleger und potenzielle deutsche Anleger werden daher dringend ersucht, sich von einem Steuerberater über die spezifischen steuerlichen Auswirkungen einer Anlage beraten zu lassen. Lediglich ein solcher Steuerberater ist in der Lage, die persönlichen Umstände und steuerlichen Konsequenzen für den jeweiligen deutschen Anleger zu prüfen.

Steuersystem Investmentfonds

Das aktuelle deutsche Investmentsteuergesetz („**InvStG**“) unterscheidet zwischen „Investmentfonds“ gemäß Definition in § 1 Abs. 2 des InvStG und „Spezial-Investmentfonds“ gemäß Definition in § 26 des InvStG, bei denen es sich um Investmentfonds handelt, die bestimmte zusätzliche Anforderungen erfüllen müssen. Alle Teilfonds der Gesellschaft („**Fonds**“) sollten gemäß InvStG als Investmentfonds behandelt werden und nicht unter das Steuersystem für Spezial-Investmentfonds fallen.

Die folgenden Details zu den deutschen Steueraspekten beziehen sich deshalb ausschließlich auf die für Investmentfonds gemäß Definition im InvStG geltenden Regelungen. Investmentfonds unterliegen im Allgemeinen einer intransparenten Besteuerung, d. h. die Besteuerung auf Fondsebene erfolgt getrennt von der Besteuerung auf Anlegerebene.

Deutsche Besteuerung auf Fondsebene

Im Regelfall unterliegen deutsche und ausländische Investmentfonds in Bezug auf deutsche Dividendenerträgen und bestimmte andere deutsche Einkünften im Sinne von § 6 des InvStG der deutschen Körperschaftsteuer. Kapitalgewinne aus der Veräußerung von Anteilen an Kapitalgesellschaften sind in Deutschland auf Ebene der Investmentfonds grundsätzlich nicht steuerpflichtig (für Kapitalgewinne aus der Veräußerung von Anteilen an einer deutschen oder ausländischen immobilienlastigen Kapitalgesellschaft [d. h. einer Kapitalgesellschaft, deren Aktienwert sich zu einem beliebigen Zeitpunkt innerhalb eines Zeitraums von 365 Tagen vor der Veräußerung aus mehr als 50 % deutscher Immobilien stammt] gilt eine Ausnahme, wenn ein Investmentfonds zu einem beliebigen Zeitpunkt innerhalb der letzten fünf Jahre vor der Veräußerung direkt oder indirekt mindestens 1 % des Grundkapitals gehalten hat).

Bei deutschen Dividendenerträgen wird eine endgültige deutsche Steuer an der Quelle einbehalten.

Der deutsche Quellensteuersatz beträgt in der Regel 26,375 % (einschließlich eines Solidaritätszuschlags von 5,5 %). Für Investmentfonds, die über eine gültige Fondsstatusbescheinigung verfügen und diese der jeweiligen für die Quellensteuer zuständigen Stelle vorgelegt haben, gilt ein Quellensteuersatz von 15,0 % (einschließlich 5,5 % Solidaritätszuschlag). Fonds, die in deutsche Vermögenswerte investieren, werden die Fondsstatusbescheinigung beantragen.

Für Einkünfte aus deutschen Quellen, die nicht der deutschen Quellensteuer unterliegen, beträgt der deutsche Körperschaftsteuersatz 15,825 % (einschließlich eines Solidaritätszuschlags von 5,5 %). Die deutsche Steuer wird im Zuge einer jährlichen Steuerveranlagung mit Steuererklärungspflicht für den Investmentfonds erhoben.

Ein Investmentfonds ist grundsätzlich von der deutschen Gewerbesteuer befreit, es sei denn, er verwaltet sein Vermögen aktiv und unternehmerisch über eine feste deutsche Niederlassung (vorbehaltlich einer Bagatellgrenze).

Deutsche Besteuerung auf Fondsebene

Gemäß dem InvStG werden deutsche Anleger für die folgenden Erträge aus einem Investmentfonds (sogenannte „**Kapitalerträge**“) besteuert:

- Ausschüttungen, einschließlich Dividenden und Rückzahlungen von eingezahltem Kapital aus einem Investmentfonds;
- die sogenannte Vorabpauschale (weitere Einzelheiten siehe unten); und
- Kapitalgewinne aus einer Veräußerung/Rücknahme von Investmentfondsanteilen.

Die Vorabpauschale wird deutschen Anlegern jedes Jahr am ersten Werktag des Kalenderjahres für das vorangegangene Kalenderjahr als versteuerbares Einkommen zugerechnet. Die Vorabpauschale wird wie folgt berechnet: Rücknahmepreis (oder alternativ der Börsenkurs oder der Marktpreis) pro Investmentfondsanteil zu Beginn des Kalenderjahres, multipliziert mit 70 % des vom Bundesfinanzministerium veröffentlichten sogenannten Basiszinssatzes. Die Vorabpauschale wird um die tatsächlichen Ausschüttungen des jeweiligen Kalenderjahres reduziert. Die Vorabpauschale wird zusätzlich durch den tatsächlichen Anstieg des Rücknahmepreises (oder gegebenenfalls des Börsenkurses oder des Marktpreises) des Investmentfondsanteils während des Kalenderjahres begrenzt.

Die Kapitalerträge unterliegen in der Regel:

- der deutschen Einkommensteuer mit einem pauschalen Steuersatz von 25 % (zuzüglich Solidaritätszuschlag und gegebenenfalls Kirchensteuer) für deutsche Anleger, die Investmentfondsanteile als Privatvermögen halten („Privatanleger“);
- der deutschen Einkommensteuer zum persönlichen progressiven Einkommensteuersatz (bis zu 45 % zuzüglich Solidaritätszuschlag und gegebenenfalls Kirchensteuer) und der deutschen Gewerbesteuer zum jeweiligen lokalen Gewerbesteuersatz im Falle deutscher Anleger, die Anteile an Investmentfonds als betriebliches Vermögen halten („betriebliche Anleger“); und
- der deutschen Körperschaftsteuer in Höhe von 15 % (zuzüglich Solidaritätszuschlag) und der deutschen Gewerbesteuer zum jeweiligen lokalen Gewerbesteuersatz für deutsche Anleger, die als körperschaftsteuerpflichtig gelten („Unternehmensanleger“).

Die Anleger eines Investmentfonds können von einer teilweisen Steuerbefreiung für Kapitalerträge aus einem Investmentfonds (d. h. Ausschüttungen, die Vorabpauschale und Kapitalgewinne aus der Veräußerung/Rücknahme von Anteilen eines Investmentfonds) profitieren, wenn der jeweilige Investmentfonds gemäß § 2 Abs. 6 und 7 InvStG als „Aktienfonds“ oder „Mischfonds“ eingestuft ist (siehe weiter unten). Die aktuellen Sätze der teilweisen Steuerbefreiung sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt:

	Privatanleger	Betriebliche Anleger	Betriebliche Anleger
Equity Fund	30 %	60 %	80 %
Mischfonds	15 %	30 %	40 %

Die (erhöhten) Teilsteuerbefreiungen für betriebliche Anleger und Unternehmensanleger haben keine Geltung weder für (i) Lebens- und Krankenversicherungsgesellschaften, wenn Anteile an einem Investmentfonds ihren Kapitalanlagen zuzurechnen sind, noch für (ii) Kredit- oder Finanzdienstleistungsunternehmen, wenn Anteile an einem Investmentfonds ihrem Handelsbestand zuzurechnen sind, oder für (iii) Finanzunternehmen, die zu mehr als 50 % direkt oder indirekt im Besitz von Kredit- oder Finanzdienstleistungsunternehmen sind, wenn Anteile an einem Investmentfonds zum Zeitpunkt des Erwerbs dem Umlaufvermögen zuzurechnen sind. In diesen Fällen gilt die teilweise Steuerbefreiung für Privatanleger (d. h. 30 % bzw. 15 %).

Für die deutsche Gewerbesteuer gilt nur die Hälfte der oben genannten teilweisen Steuerbefreiungen.

Die Einstufung eines Investmentfonds als Aktienfonds oder Mischfonds gemäß dem InvStG hängt davon ab, ob ein Fonds bestimmte Schwellenwerte für „Kapitalbeteiligungen“ erfüllt:

- Aktienfonds sind Investmentfonds, die gemäß ihren Anlagebedingungen mindestens 50 % ihres Nettoinventarwerts (Wert des Investmentfonds) kontinuierlich in Kapitalbeteiligungen im Sinne von § 2 Abs. 8 des InvStG (§ 2 Abs. 6, Abs. 9b Satz 2 des InvStG) anlegen. Für die Berechnung des Mindestschwellenniveaus von mehr als 50 % muss der Wert der Kapitalbeteiligungen um die vom Investmentfonds aufgenommenen Darlehen proportional zum prozentualen Anteil des Werts der Kapitalbeteiligungen am gesamten Bruttovermögen des Investmentfonds reduziert werden (§ 2 Abs. 9b Satz 3 des InvStG).
- Mischfonds sind Investmentfonds, die gemäß ihren Anlagebedingungen mindestens 25 % ihres Nettoinventarwerts (Wert des Investmentfonds) kontinuierlich in Kapitalbeteiligungen im Sinne von § 2 Abs. 8 des InvStG (§ 2 Abs. 7, Abs. 9b Satz 2 des InvStG) anlegen. Für die Berechnung des Mindestschwellenniveaus von mindestens 25 % muss der Wert der Kapitalbeteiligungen um die vom Investmentfonds aufgenommenen Darlehen proportional zum prozentualen Anteil des Werts der Kapitalbeteiligungen am gesamten Bruttovermögen des Investmentfonds reduziert werden (§ 2 Abs. 9b Satz 3 des InvStG).

Als Kapitalbeteiligungen im Sinne von § 2 Abs. 8 des InvStG gelten im Allgemeinen:

- a) Anteile an einer Kapitalgesellschaft, die zum amtlichen Handel an einer von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht („BaFin“) anerkannten Börse oder einem organisierten, von der BaFin anerkannten Markt zugelassen sind;
- b) Anteile an einer Kapitalgesellschaft, die gemäß dem deutschen Recht nicht als Immobiliengesellschaft gilt und die (i) entweder in einem EU-Mitgliedstaat oder einem EWR-Mitgliedstaat ansässig ist und dort der Ertragsbesteuerung für Kapitalgesellschaften unterliegt und nicht von dieser Steuer befreit ist oder (ii) in einem Drittstaat ansässig ist und dort einer Ertragsbesteuerung für Kapitalgesellschaften in Höhe von mindestens 15 % unterliegt und nicht von dieser Steuer befreit ist;
- c) Investmentanteile an Aktienfonds in Höhe von 51 % des Werts des Investmentanteils oder – wenn die Anlagebedingungen des Aktienfonds eine höhere Mindestanlage in Kapitalbeteiligungen vorsehen – in Höhe des jeweils höheren Prozentsatzes des Werts des Investmentanteils;
- d) Investmentanteile an Mischfonds in Höhe von 25 % des Werts des Investmentanteils oder – wenn die Anlagebedingungen des Mischfonds eine höhere Mindestanlage in Kapitalbeteiligungen vorsehen – in Höhe des jeweils höheren Prozentsatzes des Werts des Investmentanteils;

Abgesehen von den oben genannten Fällen gelten Anteile an anderen Investmentfonds nicht als Kapitalbeteiligungen. Darüber hinaus gelten die folgenden Beteiligungen gemäß § 2 Abs. 8 Satz 5 des InvStG nicht als Kapitalbeteiligungen:

1. Anteile an Personengesellschaften, auch wenn die Personengesellschaften selbst Anteile an Kapitalgesellschaften halten,

2. Anteile an Kapitalgesellschaften, die nach § 2 Abs. 9 Satz 6 des InvStG als Immobilien gelten,
3. Anteile an Kapitalgesellschaften, die von der Ertragsbesteuerung befreit sind, soweit sie Ausschüttungen vornehmen, es sei denn, die Ausschüttungen unterliegen einer Besteuerung von mindestens 15 % und der Investmentfonds ist nicht davon befreit.
4. Anteile an Kapitalgesellschaften,
 - a) deren Einnahmen unmittelbar oder mittelbar zu mehr als 10 % aus Beteiligungen an Kapitalgesellschaften stammen, die nicht die Voraussetzungen von § 2 Abs. 8 Satz 1 Nr. 2 des InvStG erfüllen, d. h. wie oben unter b) der vorgenannten Definition von Kapitalbeteiligungen beschrieben, nicht ausreichend besteuert sind; oder
 - b) die unmittelbar oder mittelbar Beteiligungen an Kapitalgesellschaften halten, die nicht die Voraussetzungen von § 2 Abs. 8 Satz 1 Nr. 2 des InvStG erfüllen, d. h. wie oben unter b) der vorgenannten Definition von Kapitalbeteiligungen beschrieben, nicht ausreichend besteuert sind, wenn der gemeine Wert derartiger Beteiligungen mehr als 10 % des gemeinen Werts der Kapitalbeteiligungen beträgt.

Änderungen in der Anlagepolitik und den Anlagebeschränkungen des jeweiligen Fonds können für Zwecke der deutschen Teilerbesteuerung zu einer Neueinstufung führen. Die rechtliche und steuerliche Behandlung der Fonds durch die deutschen Steuerbehörden kann sich auf eine Weise ändern, die unvorhersehbar ist und außerhalb der angemessenen Kontrolle der Gesellschaft liegt.

Die Gesellschaft will sich nach besten Kräften bemühen, alle für die Besteuerung der in Deutschland ansässigen Kapitalanleger im Rahmen des InvStG maßgeblichen Informationen über eine Meldung an den WM-Datenservice bereitzustellen. Diese Berichterstattung beinhaltet die Veröffentlichung des teilweisen Steuerbefreiungsstatus der Fonds, die regelmäßige Kapitalbeteiligungsquote anhand des NIW der Fonds sowie andere maßgebliche Steuerinformationen für Kapitalanleger. Die jährlichen Steuerinformationen sind auch auf unserer Homepage abrufbar: www.statestreet.com/im.

7. Teilweiser Steuerbefreiungsstatus der Fonds

1) Aktienfonds

Die folgenden Fonds der Gesellschaft halten die Anlagebeschränkungen ein, die erforderlich sind, um sich als Aktienfonds gemäß § 2 Abs. 6 des InvStG zu qualifizieren, und investieren daher fortlaufend mehr als 50 % ihres Nettoinventarwerts (*Wert des Investmentfonds*) in Kapitalbeteiligungen im Sinne von § 2 Abs. 8 des InvStG (§ 2 Abs. 6, Abs. 9b Satz 2 des InvStG). Für die Berechnung des Mindestschwennenniveaus von mehr als 50 % muss der Wert der Kapitalbeteiligungen um die vom jeweiligen Fonds aufgenommenen Darlehen proportional zum prozentualen Anteil des Werts der Kapitalbeteiligungen am gesamten Bruttovermögen des jeweiligen Fonds reduziert werden (§ 2 Abs. 9b Satz 3 des InvStG).

Dessen ungeachtet kann die angestrebte Anlage in Kapitalbeteiligungen höher sein als das in der folgenden Tabelle angegebene Minimum von mehr als 50 %. Die tatsächliche Kapitalbeteiligungsquote der Fonds wird an jedem Bewertungstag der Fonds ermittelt und über den WM Datenservice veröffentlicht.

Fonds	Angestrebte Kapitalbeteiligungs quote
State Street SPDR MSCI All Country World UCITS ETF	60
State Street SPDR MSCI All Country World Investable Market UCITS ETF	60
State Street SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF	60
State Street SPDR MSCI Emerging Markets UCITS ETF	60
State Street SPDR MSCI Emerging Markets Small Cap UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF	60
State Street SPDR FTSE UK All Share UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P UK Dividend Aristocrats UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P 500 UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF	60
State Street SPDR MSCI EMU UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF	60
State Street SPDR MSCI Japan UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P 500 Leaders UCITS ETF	80
State Street SPDR MSCI World UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF	90
State Street SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF	90
State Street SPDR S&P Global Dividend Aristocrats Screened UCITS ETF	80

State Street SPDR S&P 500 Quality Aristocrats UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap Leaders UCITS ETF	80
State Street SPDR S&P Developed Quality Aristocrats UCITS ETF	60
State Street SPDR S&P Europe Quality Aristocrats UCITS ETF	60
State Street Saudi Arabia Enhanced Active Equity UCITS ETF	80
State Street Global Dividend Spotlight Active Equity UCITS ETF	80
State Street All World Enhanced Active Equity UCITS ETF	80
State Street World Small Cap Enhanced Active Equity UCITS ETF	80

Darüber hinaus können Fonds, die als Dach-Investmentfonds eingestuft sind, die tatsächlichen Kapitalbeteiligungsquoten berücksichtigen, die von ihren Ziel-Investmentfonds an jedem Bewertungstag veröffentlicht werden. Zu diesem Zweck dürfen nur Kapitalbeteiligungsquoten von Ziel-Investmentfonds berücksichtigt werden, die mindestens eine Bewertung pro Woche haben.

Zur Klarstellung wird festgehalten, dass die Mindestkapitalbeteiligungsquote von mehr als 50 % des jeweiligen Fonds Teil der Anlagerichtlinien des jeweiligen Fonds ist, weshalb sie für das Management dieses Fonds rechtlich bindend ist.

2) Mischfonds

Derzeit qualifiziert sich kein Fonds der Gesellschaft als Mischfonds gemäß § 2 Abs. 7 des InvStG.