

Ce document fournit des informations essentielles aux investisseurs de cet OPCVM. Il ne s'agit pas d'un document promotionnel. Les informations qu'il contient vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste un investissement dans ce fonds et quels risques y sont associés. Il vous est conseillé de le lire pour décider en connaissance de cause d'investir ou non. Les termes qui ne sont pas définis ici sont tels que définis dans le Prospectus.

# State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund

(le « Fonds »), un compartiment de State Street Global Advisors Luxembourg SICAV. Ce fonds est géré par State Street Global Advisors Europe Limited.

**Catégorie d'actions : I Shares (ISIN LU2243635328)**

## Objectifs et politique d'investissement

**Objectif d'investissement** Le Fonds a pour objectif de générer une croissance du capital à long terme en investissant sur le marché mondial des obligations d'entreprises libellées en USD à taux fixe de qualité « investment grade ».

**Politique d'investissement** La politique d'investissement du Fonds consiste à investir dans des obligations de sociétés qui démontrent leur capacité à réduire leurs émissions de carbone actuelles et potentielles (en fonction des réserves de combustibles fossiles), des obligations labellisées « vertes » et des obligations d'émetteurs alignés sur des objectifs climatiques, ainsi que dans des obligations d'entreprises émises par des sociétés mieux positionnées pour surmonter les risques physiques posés par le changement climatique, tout en sélectionnant les titres en fonction d'une évaluation de leur respect des critères ESG (c'est-à-dire les normes internationales relatives à la protection de l'environnement, aux droits de l'homme, aux normes du travail, à la lutte contre la corruption, aux armes controversées et au tabac). Le Gestionnaire d'investissement investira activement pour le compte du Fonds, en recourant à la Stratégie en obligations d'entreprises orientée sur le développement durable, telle que décrite plus en détail à la section « Stratégies d'investissement » du Prospectus.

La performance du Fonds sera mesurée par rapport à l'Indice Bloomberg Barclays US Corporate Bond Index.

Les titres qui composent le portefeuille sont pour la plupart sélectionnés parmi ceux qui sont inclus dans l'indice. Le portefeuille peut comprendre des titres qui ne sont pas inclus dans l'indice. La stratégie d'investissement repose sur des paramètres de risque déterminés, ce qui signifie que la

pondération du fonds en matière de notation de crédit, de secteurs et d'émetteurs sera limitée par rapport à l'indice concerné. Cela risque de limiter la capacité du Fonds à surperformer l'indice Bloomberg Barclays US Corporate Bond Index.

Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le présent Fonds investira uniquement dans :

- des obligations de sociétés ;
- d'autres fonds ;
- des actifs liquides ; et
- des instruments dérivés à des fins de gestion efficace du portefeuille et d'investissement. Ils se limiteront à des swaps, des options, des contrats à terme standardisés (futures) et des contrats de change à terme.

Le Fonds peut prêter à concurrence de 70 % des titres qu'il détient.

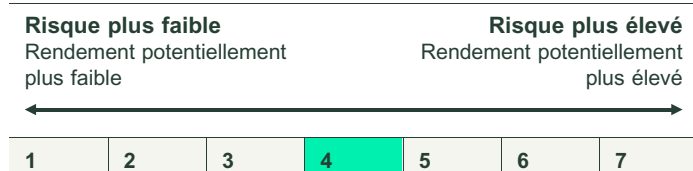
Les actions du Fonds sont émises en dollar US.

Les Actionnaires peuvent demander le rachat de leurs actions lors de tout jour ouvrable au Luxembourg et au Royaume-Uni (autre que les jours où les marchés financiers concernés sont fermés et/ou le jour précédant un tel jour à condition qu'une liste de ces jours de fermeture de marché soit publiée pour le Compartiment sur [www.ssga.com](http://www.ssga.com)) ; et tout autre jour à l'entière discrétion des Administrateurs (agissant dans les limites du raisonnable) pour autant que les Actionnaires en soient notifiés à l'avance.

Tout revenu enregistré par le Fonds sera retenu et traduit par une augmentation de la valeur des actions.

Pour toutes informations complémentaires, veuillez vous référer au Prospectus.

## Profil de risque et de rendement



**Avertissement concernant les risques** La catégorie de risque ci-dessus n'est pas une mesure des pertes ou des plus-values de capital, mais de l'importance des hausses et des baisses de rendement du Fonds constatées dans le temps.

Par exemple, un fonds dont les hausses et baisses de rendement ont été significatives sera classé dans une catégorie de risque supérieure, tandis qu'un fonds dont les hausses et baisses de rendement ont été moins importantes sera classé dans une catégorie de risque inférieure.

La catégorie la plus faible (c.-à-d., la catégorie 1) ne signifie pas qu'un fonds est « sans risque ».

La catégorie de risque du Fonds a été calculée sur la base de données de substitution historiques simulées et peut ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur du Fonds.

La catégorie de risque associée au Fonds n'est pas garantie et peut évoluer dans le temps.

**Pourquoi ce Fonds est-il dans cette catégorie ?** Le Fonds est compris dans la catégorie de risque 4 car son rendement a connu historiquement des variations moyennes à la hausse comme à la baisse.

Les paragraphes ci-dessous détaillent les risques importants pour le Fonds non pris en compte dans cet indicateur.

**Risque lié à la couverture de change :** Les couvertures font parfois l'objet d'équivalences imparfaites entre l'opération de couverture et le risque que l'on tente de couvrir. Rien ne garantit que les opérations de couverture du Fonds seront efficaces. Comme le but de la couverture de change consiste à réduire ou éliminer les pertes entraînées par des variations de taux de change, elle peut également réduire ou éliminer les plus-values lorsque la devise dans laquelle le Fonds est libellé s'apprécie.

**Risque ESG :** Si le Compartiment investit dans des sociétés en tenant compte de critères environnementaux, sociaux et de gouvernance d'entreprise (ESG), la performance du Compartiment peut suivre les rendements d'un portefeuille de titres comprenant des sociétés qui ne sont

pas exclues en raison de ces critères ESG. Investir uniquement dans un portefeuille de titres qui ne sont pas exclus du fait de ces critères ESG peut affecter l'exposition du Compartiment à certains types d'investissements et avoir un impact négatif sur la performance du Compartiment.

**Risque de liquidité :** Le manque d'un marché disponible ou des restrictions à la vente peuvent limiter la capacité du Fonds à vendre un titre à un moment ou à un prix avantageux, ou tout simplement à le vendre. Les titres illiquides sont susceptibles d'être négociés avec une décote par rapport à des investissements comparables plus liquides et ils peuvent être soumis à des fluctuations considérables de leur valeur de marché. L'illiquidité des positions du Fonds peut limiter sa capacité à obtenir des liquidités pour honorer les demandes de rachat en temps voulu.

**Risque de modélisation :** Le Gestionnaire d'investissement recourt à des modèles quantitatifs dans le but d'améliorer les rendements et de gérer les risques. Toute imperfection, erreur ou limite de ces modèles ou de leur programmation est susceptible de limiter tout bénéfice tiré par le Fonds découlant de l'utilisation des modèles ou pourrait entraîner des données incorrectes ou des résultats d'investissement différents ou opposés à ceux attendus ou souhaités par le Gestionnaire d'investissement. Il est possible que ces imperfections, erreurs ou limites ne soient jamais détectées, ou qu'elles le soient uniquement après qu'un Fonds eut supporté une perte (ou des performances réduites). En outre, rien ne garantit que les modèles se comporteront comme escompté dans toutes les conditions de marché.

**Risque lié au prêt de titres :** Si le Fonds réalise des prêts de titres, il existe un risque que l'emprunteur n'honore pas ses obligations de restituer des titres équivalents aux titres prêtés. Cela expose le Fonds au risque de contrepartie. Dans ce cas, le Fonds pourrait également connaître des retards lors de la récupération des titres et peut subir des pertes en capital. Le Fonds pourrait également perdre de l'argent si la valeur des garanties détenues en échange des titres prêtés diminue.

**Risque de Catégorie d'actions :** Il n'y a pas de séparation des passifs entre les Catégories du Fonds. Le Gestionnaire d'investissement s'efforcera de garantir que les plus/moins-values sur stratégie de couverture de change et les frais des instruments dérivés y étant associés soient imputés exclusivement à la Catégorie à laquelle ils s'adressent, mais les transactions pourraient entraîner des dettes pour d'autres Catégories.

**Intégration des Risques liés à la durabilité :** l'intégration des Risques liés à la durabilité dans le processus d'investissement du Fonds ne garantit pas l'atténuation de tout ou partie de ces risques. Toute détérioration du profil

financier d'un investissement sous-jacent en raison d'un Risque lié à la durabilité peut avoir un impact négatif équivalent sur la Valeur nette d'inventaire et/ou la performance du Fonds investi.

**Risque lié à la classification du Fonds au titre du Règlement SFDR :** le Règlement SFDR est progressivement entré en vigueur à partir du 10 mars 2021 et impose de nouvelles obligations en matière de publication d'informations aux participants des marchés financiers. À la date du Prospectus, les normes techniques de réglementation (de niveau 2) du Règlement SFDR ont été publiées mais ne sont pas adoptées par la Commission européenne, et certains concepts récemment introduits par le

Règlement SFDR ne font pas actuellement l'objet de normes d'exécution centralisées, de directives locales ou de pratiques de marché établies. Le Fonds a été évalué et classé de bonne foi sur la base des informations pertinentes actuellement disponibles. Compte tenu de l'évolution de ces normes et directives, les informations relatives au Règlement SFDR et la **classification de l'Article 9** indiquée dans le Supplément et sur le site Internet sont susceptibles d'être modifiées et peuvent ne plus s'appliquer. Veuillez vous reporter au Prospectus pour des informations détaillées concernant les risques liés à ce Fonds.

### Frais

Les frais et commissions acquittés servent à couvrir les coûts d'exploitation du Fonds, y compris les coûts de commercialisation et de distribution des parts. Ces frais réduisent la croissance potentielle de votre investissement.

Les frais d'entrée et de sortie indiqués sont les valeurs maximales. Ainsi, il se peut que vos frais soient inférieurs – pour plus d'informations sur ce point veuillez consulter votre conseiller financier ou distributeur.

Le montant des frais courants communiqué ici est une estimation. Les frais courants ne comprennent pas :

- Les frais d'intermédiation excepté dans le cas de frais d'entrée / de sortie payés par le Fonds lorsqu'il achète ou vend des parts d'un autre fonds. Pour en savoir plus sur les frais, veuillez vous reporter à la section « Frais et commissions » du prospectus ainsi qu'au supplément du Fonds.

#### Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement

Frais d'entrée	0,00 %
Frais de sortie	2,00 %

Le pourcentage indiqué est le maximum pouvant être prélevé sur votre capital avant que celui-ci ne soit investi et avant que le revenu de votre investissement ne vous soit distribué.

#### Frais prélevés par le fonds sur une année

Frais courants	0,32 %
----------------	--------

#### Frais prélevés par le fonds dans certaines circonstances

Commission de performance	Aucune
---------------------------	--------

### Performances passées



Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs.

Les performances passées présentées ici tiennent compte de l'ensemble des frais et coûts. Les frais d'entrée/de sortie sont exclus du calcul des performances passées.

Le Fonds a été lancé en mai 2021.

Les Actions de catégorie I ont été lancées en mai 2021.

### Informations pratiques

**Dépositaire** State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch.

**Autres Informations** Vous pouvez obtenir gratuitement des copies du Prospectus, de ses Suppléments ainsi que les derniers rapports annuels et semestriels préparés pour State Street Global Advisors Luxembourg SICAV en vous adressant à l'Agent administratif ou en consultant le site web [www.ssga.com](http://www.ssga.com). Ces documents sont disponibles en anglais. Pour obtenir des informations sur les autres catégories d'actions, veuillez vous reporter au site web.

Il est possible de se procurer sans frais le prospectus, le document d'information clé pour l'investisseur et les statuts constitutifs de la société ainsi que les rapports annuels et semestriels auprès du représentant en Suisse, State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, Postfach, 8027 Zurich. L'agent payeur de la Société en Suisse est State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, Postfach, 8027 Zurich.

**Politique de rémunération** Les détails de la politique de rémunération actualisée de State Street Global Advisors Europe Limited sont disponibles sur [www.ssga.com](http://www.ssga.com). Les exemplaires papier sont gracieusement mis à disposition sur demande.

**Publication de la Valeur liquidative** La Valeur Liquidative par action est disponible sur [www.ssga.com](http://www.ssga.com) et au siège social de la société.

**Fiscalité** Le Fonds est soumis à la législation et à la réglementation fiscales de Luxembourg. Selon votre pays de résidence, ces dernières peuvent avoir un effet sur la valeur de vos placements. Pour obtenir de plus amples informations, il vous est recommandé de consulter un conseiller fiscal.

**Déclaration de responsabilité** La responsabilité de State Street Global Advisors Europe Limited peut être engagée sur la base des déclarations contenues dans le présent document qui se révéleraient trompeuses, inexactes ou non cohérentes avec les parties correspondantes du Prospectus.

**Conversion entre compartiments** Les actionnaires peuvent convertir leurs actions en une autre catégorie d'actions du même Compartiment. La Section « Échange » du Prospectus contient des informations détaillées sur les modalités applicables aux échanges entre catégories d'actions. Les critères d'admissibilité de la Catégorie d'actions sont énumérés dans la Section « Catégories d'actions » du Prospectus.

Toute demande de conversion d'actions d'un Compartiment à un autre sera considérée comme un rachat d'un Compartiment suivi par une souscription d'un autre Compartiment.

**Séparation des Actifs et des Passifs** State Street Global Advisors Luxembourg SICAV a séparé le passif de chacun de ses compartiments. En conséquence, l'actif du Fonds ne devrait pas être disponible pour payer les dettes de tout autre compartiment de State Street Global Advisors Luxembourg SICAV.

**Réglementations relatives à la communication d'informations en matière de finance durable (Sustainable Finance Disclosure Regulations, « SFDR »)** Les informations décrivant la manière dont State Street Global Advisors Europe Limited prend en compte les risques de durabilité lors du processus d'investissement adopté dans le cadre de sa gestion du Fonds sont disponibles dans le Prospectus ou sur notre site Internet [www.ssga.com](http://www.ssga.com).