

SPDR® S&P® Global Dividend Aristocrats ESG UCITS ETF (Dist)

Objectif du fonds

L'objectif du fonds est de répliquer la performance de certaines actions offrant un fort rendement du dividende sur le marché mondial.

Caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG)

Le fonds intègre des caractéristiques environnementales et sociales, mais son objectif n'est pas l'investissement durable. Le fonds est catégorisé « article 8 » selon le Règlement européen (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers ("SFDR")

Le filtrage ESG s'applique à au moins 90 % du portefeuille. Il vise une notation ESG du portefeuille plus élevée que celle de l'indice S&P Global Dividend Aristocrats Quality Income, ce filtrage éliminant de l'indice au moins les 20% de titres les moins bien notés au plan ESG.

Principales limites méthodologiques : il est possible que certaines données ESG soient incohérentes, inexactes ou inexistantes, notamment lorsqu'elles sont émises par des fournisseurs de données externes. Des détails sur ces limites sont donnés dans le Supplément.

Pour plus d'informations sur le type de caractéristiques ESG, la stratégie ESG, le processus d'investissement et le type d'approche merci de consulter le Prospectus et le Supplément du Fonds.

Description de l'indice

L'indice mesure la performance pondérée par le rendement du dividende de 100 actions de l'indice S&P Global BMI parmi celles offrant les plus forts dividendes, qui ont suivi une politique de versement d'un dividende stable ou en hausse depuis au moins 10 années consécutives, après filtrage selon les notations S&P DJI ESG Score pour respecter certains critères ESG et fondamentaux spécifiques.

Statut Fiscal

SSGA a pour critère de satisfaire à toutes les obligations de déclaration fiscale applicables, et ce pour l'ensemble des ETF SPDR dans les pays suivants. Les demandes sont déposées tout au

Fiche produit

30 avril 2024

Environnement, Social et Gouvernance

long de l'exercice en fonction du calendrier requis par chacune des autorités fiscales locales : R.U., Allemagne, Autriche, Suisse.

Pays d'enregistrement

Suède, Royaume-Uni, Pays-Bas, Norvège, Luxembourg, Italie, Irlande, France, Finlande, Espagne, Danemark, Autriche, Allemagne

Ces informations sont à l'attention exclusive des investisseurs professionnels des pays où le fonds est enregistré - elles ne sont destinées ni aux investisseurs particuliers, ni aux « US Persons ».

Information sur le fonds

ISIN	IE00BYTH5S21
Indice	S&P Global ESG Dividend Aristocrats Quality Income Index
Ticker Indiciel	SPGEDAUN
Type d'Indice	Total Return Net
Nombre De Sous-Jacents	98

Informations Clés

Date de lancement	03-juin-2021
Devise de Base	USD
Fonds — Devise de Base	USD
Total des Frais sur Encours	0,45%
Traitement des revenus	Distribution trimestrielle
Méthode de Réplication	Réplication
Conforme à UCITS	Oui
Classification SFDR des fonds	SFDR – Article 8
Domicile	Irlande
Gestionnaire	State Street Global Advisors Europe Limited
Gestionnaire délégué	State Street Global Advisors Limited
Ombrelle	SSGA SPDR ETFs Europe I plc
Encours de la part (en millions)	US\$16,45
Actifs gérés (en millions)	US\$16,45
Eligible ISA	Oui
Eligible SIPP	Oui
Eligible PEA	Non

Veillez noter qu'en raison de la clôture des marchés pour tous les compartiments SSGA SPDR ETF Europe I & II le vendredi 29 mars 2024, le prix du fonds reflétera la valeur liquidative du jeudi 28 mars, ce qui signifie que les performances mensuelles du fonds peuvent différer de l'indice de référence.

Cotation						
Bourse	Ticker	Devise de Transaction	Code iNAV	Code Bloomberg	Code Reuters	Code SEDOL
Deutsche Börse*	ZPD3	EUR	INZPD3E	ZPD3 GY	ZPD3.DE	BYTH5S2
Euronext Amsterdam	GEDV	EUR	INZPD3E	GEDV NA	GEDV.AS	BLFHDZ8
London Stock Exchange	GEDV	USD	INZPD3	GEDV LN	GEDV.L	BLFHF07

*Premiere Cotation

Performance

	Indice	Fonds Brut	Ecart	Fonds Net	Ecart
Rendements Annualisés (%)					
1 An	5,81	6,34	0,52	5,86	0,05
3 Ans	-	-	-	-	-
5 Ans	-	-	-	-	-
10 Ans	-	-	-	-	-
Depuis début	1,29	1,70	0,41	1,25	-0,04

Performances Cumulée (%)

1 Mois	-2,69	-2,57	0,12	-2,61	0,08
3 Mois	0,43	0,53	0,10	0,42	-0,01
1 An	5,81	6,34	0,52	5,86	0,05
2 Ans	5,36	6,40	1,04	5,45	0,09
3 Ans	-	-	-	-	-
5 Ans	-	-	-	-	-
10 Ans	-	-	-	-	-
Depuis début	3,79	5,03	1,24	3,67	-0,13

Performances annuelles (%)

2024	-1,42	-1,29	0,13	-1,44	-0,02
2023	8,66	9,09	0,42	8,60	-0,06
2022	-2,24	-1,73	0,51	-2,17	0,07
2021	-0,89	-0,75	0,14	-1,00	-0,12

	Fonds (%)
Volatilité (3 Ans)	-
Tracking Error Annualisée (3 Ans)	-

La performance passée n'est pas représentative de la performance future. Les montants bruts de commissions ne tiennent pas compte et les montants nets de commissions tiennent compte des commissions et des coûts entraînés par l'émission et le rachat de parts, ou par les achats et ventes de celles-ci. Si la performance est calculée sur la base des valeurs liquidatives brutes/nettes qui ne sont pas libellées dans la devise comptable de l'organisme de placement collectif, elle peut varier à la hausse ou à la baisse en fonction des fluctuations de change. Lorsque le Compartiment est fermé conformément à son calendrier officiel concernant la Valeur liquidative (VL), une partie significative des prix des titres sous-jacents pouvant néanmoins être déterminée, une VL technique est calculée. La performance passée indiquée ici a donc été calculée à l'aide d'une VL technique lorsque cela s'est avéré nécessaire, ainsi que la VL officielle du Fonds pour chaque autre jour ouvrable sur la période concernée.

Les rendements de performance enregistrés depuis le lancement seront partiels pour l'année civile, si la date de lancement du Fonds en question, ou la date de lancement du Fonds auquel est liée la performance historique (la date retenue étant la plus proche) est incluse dans cette période.

Caractéristiques

Nombre de Lignes	97
*Rendement des distributions	3,89%
Ratio Cours/Bénéfice EF1	12,51
Average Price/Book	1,72
Average Market Cap (Mio)	US\$55.952,96
Rendement de l'indice	5,27%

* Mesure l'historique du dividende versé par action sur 12 mois, divisé par la VL.

Source : SSGA Les caractéristiques, actifs détenus, allocations géographiques et sectorielles évoquées ici sont valables à la date indiquée au début de cette fiche d'informations et sont sujets à variations. Aucune référence à une entreprise ou un titre spécifique ne doit être interprétée comme une recommandation d'achat, de vente, de détention ou d'investissement indirect dans cette entreprise ou ce titre.

10 Premières Participations	Poids (%)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,24
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,29
ONEOK INC	2,03
LYONDELLBASELL INDU-CL A	1,85
LEGGETT & PLATT INC	1,80
LG UPLUS CORP	1,77
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	1,76
PFIZER INC	1,73
EVERSOURCE ENERGY	1,63
SPIRE INC	1,63

Repartition Sectorielle	Poids (%)
Sociétés financières	26,48
Services aux collectivités	12,71
Services de Communication	11,64
Immobilier	11,31
Energie	8,77
Industrie	7,47
Biens de consommation cycliques	6,77
Santé	4,87
Biens de consommation non-cycliques	3,75
Matériaux	3,18
Technologies de l'info	3,03

Risque de capital : Investir implique des risques, dont celui d'une perte du capital.
Les performances passées ne constituent pas un indicateur fiable des performances futures.

Repartition Geographique	Poids (%)
Etats-Unis	51,70
Japon	9,02
Canada	8,45
Suisse	6,45
Hong Kong	3,33
Italie	3,20
France	3,14
Finlande	2,52
Royaume-Uni	2,23
Corée	1,76
Taiwan	1,76
Allemagne	1,65
Irlande	1,33
Chine	1,22
Arabie Saoudite	0,99
Norvège	0,92
Autres	0,32

Nous contacter

Visitez notre site ssga.com/etfs ou contactez un représentant de l'équipe SPDR ETF France. Vous pouvez également contacter notre service client SPDR à l'adresse suivante spdrseurope@ssga.com.

France & Luxembourg

spdretf_france@ssga.com
+33 1 44 45 40 00

Italie

spdretf_italia@ssga.com
+39 0232066 140

Nordics

spdrseurope@ssga.com
+31 (0)20-7181071

Suisse

spdrsswitzerland@ssga.com
+ 41 (0)44 245 70 00

Allemagne

spdrsgermany@ssga.com
+49 69 66774 5016

Pays-Bas

spdr_nl@ssga.com
+31 (0)20-7181071

Espagne

spdrseurope@ssga.com
+39 0232066 140

Royaume-Uni

spdrseurope@ssga.com
+44 (0) 203 395 6888

ssga.com/etfs

Facteurs de Risque

Le Fonds est compris dans la catégorie de risque 6 car son rendement a connu historiquement des variations très élevées à la hausse comme à la baisse. Les risques suivants peuvent survenir sur le fonds sans être captés de manière adéquate par la catégorie de risque.

Risque de concentration

Risque de réplification indiciel

Risque de liquidité & risque de liquidité de l'ETF

Risque de filtrage

Pour des informations complémentaires sur les risques, veuillez consulter le Prospectus et les DICL.

Glossaire

Ratio cours/bénéfices pour l'exercice

1 Moyenne du cours de chaque titre sous-jacent, divisée par l'estimation moyenne du BPA du titre pour l'exercice suivant non publié, à la date du rapport.

Ratio cours moyen/valeur comptable

Moyenne du cours de chaque titre sous-jacent, divisée par la valeur comptable par action du titre, à la date du rapport.

Taux de dividendes de l'indice

Moyenne des dividendes par action (DPA) annuels pour chaque titre sous-jacent représenté dans l'indice, à la date du rapport, divisée par le cours du titre à la date du rapport.

TER Le Total des frais sur encours constitue une commission appliquée au fonds, exprimée en pourcentage de la valeur liquidative, dont l'objectif est de couvrir les coûts associés à l'exploitation et à la gestion du portefeuille d'actifs.

À l'usage exclusif des clients professionnels et des investisseurs qualifiés. Non destiné à la distribution publique.

Les fonds indiciaires négociables en bourse (ETF) sont négociés comme des actions, sont sujets

au risque d'investissement et feront l'objet de fluctuations en termes de valeur de marché. La valeur de l'investissement peut changer tant à la hausse qu'à la baisse ; le rendement sur l'investissement est donc variable en conséquence. Les variations des taux de change peuvent avoir une incidence négative sur la valeur, le cours ou le revenu d'un investissement. En outre, il ne peut être garanti qu'un ETF réalisera son objectif d'investissement.

Communication marketing

Les ETF SPDR sont susceptibles de ne pas être disponibles ou de ne pas vous convenir. Les informations fournies ne constituent pas des conseils d'investissement tel que ce terme est défini dans la Directive concernant les marchés d'instruments financiers (2014/65/UE) et elles ne doivent pas être invoquées en tant que telles. Elles ne constituent en aucune manière une sollicitation d'achat ou une offre de vente d'investissement. Elles ne tiennent pas compte des objectifs d'investissement, des stratégies, des situations fiscales, de l'appétit pour le risque ou des horizons d'investissement donnés des investisseurs existants ou futurs.

Le traitement fiscal dépend de circonstances particulières propres à chaque client et est sujet à des évolutions futures.

Si vous recherchez un conseil en investissement, veuillez solliciter votre consultant fiscal et financier, ou autre conseiller professionnel.

Veuillez consulter la dernière mise à jour du Document d'information clé (DIC)/ Document d'information clé pour l'investisseur (DICL) et du Prospectus du Fonds avant toute décision d'investissement. Les versions anglaises les plus récentes du Prospectus et du DIC/ DICL sont consultables à l'adresse www.ssga.com. Une synthèse des droits des investisseurs est disponible ici : <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights/ssga-spdr-investors-rights-summary.pdf> Veuillez noter que la Société de gestion peut décider de mettre fin aux dispositions relatives à la commercialisation et procéder à la dénotification conformément à l'art. 93a de la directive 2009/65/CE.

Tous les documents liés aux fonds peuvent être retirés à titre gracieux auprès des bureaux du représentant ou de l'agent local, sont disponibles sur le site www.ssga.com, ou peuvent être obtenus sur simple demande adressée à State Street Custodial Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irlande.

SPDR ETFs constitue la plateforme de fonds négociables en bourse (« ETF ») de State Street Global Advisors ; elle est composée de fonds agréés par les Banque centrale d'Irlande en qualité de sociétés d'investissements OPCVM à capital variable.

Les compartiments ne sont pas disponibles pour les investisseurs américains. SSGA SPDR ETFs Europe I plc et SPDR ETFs Europe I plc (« la Société »), sociétés d'investissement à capital variable de type ouvert avec une responsabilité séparée entre leurs compartiments, émettent les ETF SPDR. La Société est structurée comme un Organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) conformément à la législation irlandaise et agréée en qualité d'OPCVM par la Banque centrale d'Irlande.

Informations complémentaires importantes

- Pour le Royaume-Uni, le présent document a été publié par State Street Global Advisors Limited (« SSGA »). SSGA est agréée et réglementée par la Financial Conduct Authority, et immatriculée sous le Numéro 2509928. N° TVA 5776591 81. Siège social : 20 Churchill Place, Canary Wharf, London, E14 5HJ, Téléphone : 020 3395 6000 Télécopie : 020 3395 6350 Site internet : www.ssga.com. **Pour l'Union européenne**, le présent document a été publié par State Street Global Advisors Europe Limited (« SSGA »), société réglementée par la Banque centrale d'Irlande. Adresse du siège social : 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2. Numéro d'immatriculation 49934 Tél : +353 (0)1 776 3000. Télécopieur : +353 (0)1 776 3300. Site Internet : www.ssga.com.

Représentants locaux et agents payeurs pour les ETF SPDR :

France : State Street Bank International GmbH Paris Branch, Cœur Défense - Tour A, 100, Esplanade du Général de Gaulle, 92931 Paris La Defense Cedex ; **Suisse** : State Street Bank GmbH Munich, Zurich Branch, Beethovenstrasse 19, 8027 Zurich, et le

distributeur principal en Suisse, à savoir State Street Global Advisors AG, Beethovenstrasse 19, 8027 Zurich ; **Allemagne** : State Street Global Advisors Europe Limited, Briener Strasse 59, D-80333 Munich ; **Espagne** : Cecabank, S.A. Alcalá 27, 28014 Madrid (Espagne) ; **Danemark** : Nordea Bank Denmark A/S, Issuer Services, Securities Services Hermes Hus, Helgeshøj Allé 33 Postbox 850 DK-0900 Copenhagen C ; **Autriche** : Erste Bank, Graben 21, 1010 Vienne, Autriche ; **Suède** : SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB, Global Transaction Services ST MHI, SE-106 40 Stockholm, Suède.

L'Indice S&P 500® est un produit de SP Dow Jones Indices LLC ou de ses filiales (« S&P DJI ») et fait l'objet d'une licence d'utilisation par State Street Global Advisors. S&P®, SPDR®, S&P 500®, US 500 et « the 500 » (les 500) sont des marques déposées de Standard & Poor's Financial Services LLC (« S&P ») ; Dow Jones® est une marque déposée de Dow Jones Trademark Holdings LLC (« Dow Jones ») et a été utilisée sous licence par S&P Dow Jones Indices ; et ces marques déposées ont été utilisées sous licence par S&P DJI et concédées en sous-licence à certaines fins par State Street Global Advisors. Le fonds n'est pas sponsorisé, approuvé, vendu ou promu par S&P DJI, Dow Jones, S&P ou leurs sociétés affiliées respectives et aucune desdites parties ne saurait faire valoir l'opportunité d'investir dans le ou lesdits produits, ni ne saurait engager une quelconque responsabilité en cas d'erreur, d'omission ou d'interruption liée à l'un de ces indices.

Les marques de commerce et les marques de service référencées aux présentes appartiennent à leurs propriétaires respectifs. Les fournisseurs de données tiers ne saurient garantir ni affirmer, sous aucune forme que ce soit, l'exactitude, l'intégrité ou l'actualité des données, et ne saurient être tenus responsables de dommages d'aucune sorte qui seraient liés à l'usage de ces données. Ce document ne saurait être reproduit, copié ou transmis en tout ou partie, et son contenu ne saurait être communiqué à des tiers sans l'autorisation expresse écrite de SSGA.

Résumé du R-Factor^{MC}

R-Factor^{MC} est issu d'une méthodologie de notation transparente qui met à profit l'outil Materiality Map du Sustainability Accounting Standards Board (SASB), les codes de gouvernance d'entreprise et les données de quatre des meilleurs fournisseurs de données ESG de leur catégorie. Le facteur R soutient le développement de marchés de capitaux durables en permettant aux investisseurs d'investir dans des solutions qui intègrent les données ESG matérielles financières tout en encourageant les entreprises à améliorer leurs pratiques ESG et à divulguer de l'information dans les secteurs qui comptent.

Les données des sections ESG de cette fiche produit sont les dernières données disponibles et ont un mois de décalage par rapport à la date affichée.
Source : Factset/SSGA. Les positions sont au 30 avril 2024, les données R-factor sont au/à 31 mars 2024.

Profil du Fonds Facteur-R

Non disponible	0,00%
Retardataire	0,00%
Titres sous-performants	1,11%
Titres à rendements moyens	13,27%
Titres sur-performants	37,46%
Chef de file	48,17%

Source : Factset/SSGA depuis 31 mars 2024.

Facteur R

Résumé du facteur R (R-Factor)	Fonds
Facteur R	67

Source : Factset/SSGA depuis 31 mars 2024.

Couverture du Fonds	Compte	Pourcentage du total de titres (%)	Pourcentage de la valeur de marché totale (%)
Couverture des titres du R-Factor	97	100,00	100,00
Nombre total de titres du Fonds	97		

Source : Factset/SSGA depuis 31 mars 2024.

Les 10 principales positions	Pondération du Fonds (%)	Cote du facteur R
Highwoods Properties Inc.	3,24	64
Verizon Communications Inc.	2,29	79
ONEOK Inc.	2,03	72
LyondellBasell Industries NV	1,85	67
Leggett & Platt Incorporated	1,80	56
LG Uplus Corp	1,77	57
Vanguard International Semiconductor Corp	1,76	68
Pfizer Inc.	1,73	77
Eversource Energy	1,63	71
Spire Inc.	1,63	64

Les 5 principaux cotes du facteur R		
Sanofi	1,08	94
Allianz SE	0,65	87
National Bank of Canada	0,18	87
Sun Life Financial Inc.	0,20	84
Bank of Montreal	0,21	82

Les 5 cotes du facteur R les plus bas		
Open House Group Co. Ltd	1,11	34
SBI Holdings Inc.	0,63	46
IG Group Holdings plc	0,74	48
First Interstate BancSystem Inc.	0,95	48
Helvetia Holding Ltd	0,57	50

Source : Factset/SSGA depuis 31 mars 2024.

Le Résumé du facteur R (R-Factor) reflète seulement certaines caractéristiques ESG et ne reflète pas le rendement du fonds. Veuillez consulter la section Renseignements importants pour obtenir plus d'informations et de définitions des mesures ESG présentées.

Mesures climatiques

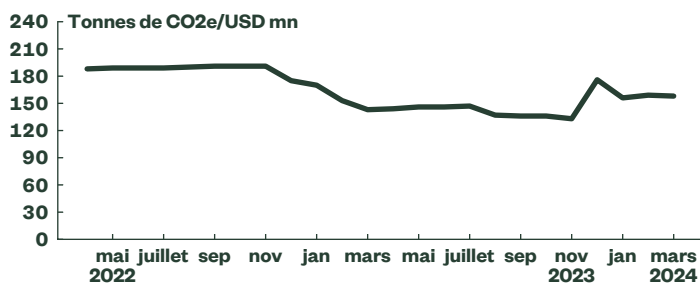
Mesure carbone (TCFD)	Fonds
Intensité carbone moyenne pondérée selon la TCFD (WACI)	153,74
Total des émissions carbonées (TCFD)**	1.375,41*
Empreinte carbone (TCFD)	84,22
Intensité carbone (TCFD)	137,67

Source : State Street Global Advisors, S&P Trucost, FactSet, Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (TCFD). Les résultats sont des estimations fondées sur des hypothèses et des analyses faites par State Street Global Advisors. Ils ne sont pas destinés à représenter les résultats réels d'une offre quelle qu'elle soit. Les résultats réels peuvent différer. * La mesure du TCFD en ce qui concerne les émissions totales de CO2 affecte les émissions aux investisseurs selon une approche basée sur les parts détenues. Dans le cas de fonds amalgamés, les résultats représentent la responsabilité environnementale de la totalité des actifs sous gestion du fonds. Concernant la responsabilité des détenteurs individuels d'unités, il est possible de calculer leur proportion de responsabilité en se basant sur le pourcentage de leurs avoirs. ** La mesure n'est pas utilisée pour comparer les portefeuilles ou les indices de référence car les données ne sont pas normalisées.

Veuillez noter que les rapports mensuels précédents depuis novembre 2023 contenaient des données incorrectes sur les émissions totales de carbone (TCE) qui ont été identifiées et corrigées. Merci de contacter votre chargé de clientèle habituel pour de plus amples détails.

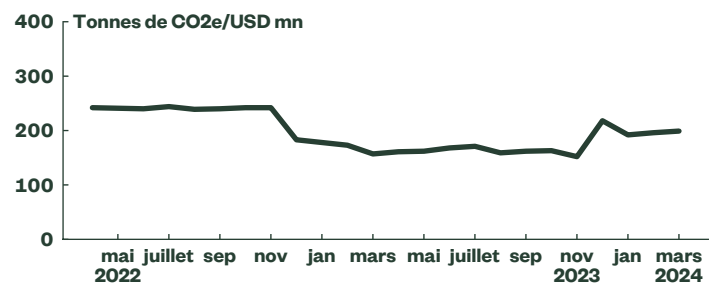
Profil climatique

Intensité Carbone (Directe + Indirecte)



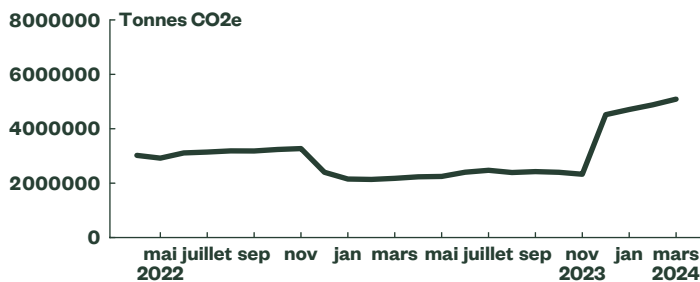
Fonds

Intensité moyenne pondérée en carbone (Directe + Indirecte)



Fonds

Émissions de carbone de portée 1+2



Fonds

Source : SSGA Holdings au 30 avril 2024. Données Trucost en date du 31 mars 2024.

Profil d'intendance T1 2024

Nombre de rencontres ayant fait l'objet d'un vote	104
Nombre de pays	5
Propositions de la direction	101
Approuvé par vote	94,06%
Refusé par vote	5,94%
Propositions d'actionnaires	0
D'accord avec la direction	0,00%
En désaccord avec la direction	0,00%

Les montants représentent une agrégation cumulative d'un trimestre à l'autre à l'échelle de SSGA et ne sont pas seulement liés au fonds.

Le programme d'intendance des actifs de State Street Global Advisors (SSGA) vise à engager le dialogue avec nos sociétés de gestion du fonds au sujet de questions qui ont une incidence sur la création de valeur à long terme relativement aux considérations d'ordre environnemental, social et de gouvernance (ESG). Récemment, SSGA a publié des directives détaillées sur les questions de gouvernance clés telles que le leadership efficace et indépendant du conseil d'administration. La priorité actuelle de SSGA est d'aider les conseils d'administration à réfléchir aux impacts possibles des questions sociales et environnementales et d'intégrer un point de vue de durabilité à la supervision du conseil d'administration dans le cadre de sa stratégie à long terme à titre de pratique commerciale saine.

Diversité des sexes	
Femmes dans les conseils d'administration	Nombre de titres
0	1
1	3
2	10
3	14
4	27
5	23
6	10
7	8
8	1
9	0
10	0
Plus de 10	0
Non disponible	0
Total	97

Source : Factset/SSGA depuis 31 mars 2024.

ssga.com/etfs

R-Factor™ R-Factor™ est un système de notation mettant à profit des cadres de référence importants, transparents et généralement reconnus qui sont supportés par un large groupe de sociétés et d'investisseurs afin de générer une notation ESG pour les sociétés cotées. Le score est accompagné de données ESG provenant de quatre différents fournisseurs (Sustainalytics, ISS-Oekom, Vigeo-EIRIS, et ISS-Governance) de manière à améliorer la couverture globale et de supprimer les biais inhérents aux méthodologies de notation existantes. R-Factor™ est conçu pour mettre les sociétés aux commandes afin de faciliter la création de marchés durables.

Les scores de R-Factor™ sont comparables dans tous les secteurs. Les scores ESG et Corporate Governance (CorpGov) sont conçus pour s'appuyer sur des questions qui sont importantes pour le secteur d'une société et une région régulatrice. Une échelle de classement uniforme permet l'interprétation du score final du niveau de la société à des fins de comparaison avec d'autres sociétés.

R-Factor™ Le processus de notation de R-Factor™ comprend deux composantes sous-jacentes. La première composante est basée sur la structure publiée par le Sustainability Accounting Standards Board (« SASB »), et est utilisée pour tous les aspects d'ordre environnemental, social et de gouvernance (ESG) du score, autres que ceux concernant les questions de gouvernance d'entreprise. Le cadre de référence SASB essaie d'identifier les risques ESG qui revêtent une importance financière pour l'émetteur en fonction de sa classification industrielle. Cette composante du score R-Factor™ est déterminée en utilisant seulement les mesures provenant des fournisseurs de données ESG qui traitent en particulier les risques ESG identifiés par le cadre de référence SASB comme étant financièrement importants pour l'émetteur en fonction de sa classification industrielle.

La seconde composante du score (le score CorpGov) est générée à partir de codes de gouvernance d'entreprise spécifiques à la région, développés par des investisseurs ou des régulateurs. Les codes de gouvernance décrivent des exigences minimales en matière de gouvernance d'entreprise d'une région en particulier et abordent généralement des sujets

tels que les droits des actionnaires, l'indépendance du conseil d'administration et la rémunération des dirigeants. Cette composante du R-Factor™ utilise des données fournies par ISS Governance pour attribuer un score en matière de gouvernance aux émetteurs en fonction de ces codes.

Profil R-Factor™ Dans chaque groupe d'industrie, les émetteurs sont classés selon cinq groupes de performance ESG distincts, en fonction du classement par centile dans lequel se range leur score R-Factor™. Une société est classée dans l'une des cinq catégories de performance ESG (En bas du classement - 10 % de l'univers d'investissement, Sous-performante - 20 %, Moyennement performante - 40 %, Surperformante - 20 % ou Chef de file - 10 %) en comparant le score R-Factor™ de la société par rapport à une tranche de scores. Les scores R-Factor™ sont normalement attribués selon des processus de notation normalisés sur une échelle de notation de 0 à 100.

Un écart entre le nombre de titres dans le récapitulatif R-Factor™ et le nombre de titres dans les rapports réguliers peut survenir dans la mesure où le récapitulatif R-Factor™ repose sur le nombre d'émetteurs plutôt que sur le nombre de titres dans le portefeuille.

Intensité des émissions de carbone (Directe+Indirecte) Mesurée en tonnes métriques d'équivalent CO2/revenus en millions USD. L'accumulation des empreintes carbone de la chaîne d'approvisionnement d'exploitation et de premier rang des constituants de l'indice par USD (pondéré à l'identique).

Intensité des émissions de carbone moyenne pondérée (Directe+Indirecte) Mesurée en tonnes métriques d'équivalent CO2/revenus en millions USD. La moyenne pondérée des intensités d'une société individuelle (émissions de la chaîne d'approvisionnement d'exploitation et de premier rang par rapport aux revenus), pondérées par la part de chaque constituant dans l'indice.

Émissions de carbone de portée 1+2 Mesurées en tonnes métriques d'équivalent CO2. Les émissions de gaz à effet de serre provenant des exploitations possédées ou contrôlées par la société, ainsi que les émissions de gaz à effet de serre (GES) provenant de la consommation d'électricité, de chaleur ou de vapeur d'eau achetées par la société.

Intensité carbone moyenne pondérée (TCFD)

- Exposition du portefeuille aux entreprises à forte intensité carbone, exprimée en tonnes CO₂/million d'USD de chiffre d'affaires. Les émissions de GES des Scopes 1 et 2 sont réparties en fonction des pondérations du portefeuille (la valeur actuelle de l'investissement par rapport à la valeur actuelle du portefeuille).

Total des émissions carbone (TCFD) - Les émissions absolues de gaz à effet de serre associées à un portefeuille, exprimées en tonnes CO₂. Les émissions de GES des Scopes 1 et 2 sont attribuées aux investisseurs sur la base d'une approche de participation au capital.

Empreinte carbone (TCFD) - Total des émissions carbone d'un portefeuille normalisé par la valeur de marché du portefeuille, exprimé en tonnes CO₂/million d'USD investi. Les émissions de GES des Scopes 1 et 2 sont attribuées aux investisseurs sur la base d'une approche de participation au capital.

Intensité carbone (TCFD) - Volume des émissions de carbone par million de dollars de chiffre d'affaires (efficacité carbone d'un portefeuille), exprimé en tonnes CO₂/million d'USD de chiffre d'affaires. Les émissions de GES des Scopes 1 et 2 sont attribuées aux investisseurs sur la base d'une approche de participation au capital.

Mixité Nous utilisons actuellement l'ensemble de données des « collaborateurs » de FactSet, eux-mêmes pour communiquer le nombre de femmes faisant partie du conseil d'administration, dans chaque société du portefeuille du Fonds. Les données et mesures proviennent des contributeurs énumérés ci-dessous à la date de ce rapport et font l'objet de leurs divulgations ci-après. Toutes les autres données proviennent de SSGA.

Sections Trucost Intensité carbone (Directe+Indirecte), intensité des émissions de carbone moyenne pondérée (Directe+Indirecte), émissions de carbone de portée 1+2, réserves totales des émissions de CO₂. Trucost® est une marque déposée de S&P Trucost Limited ("Trucost") et est exploitée sous licence. Le rapport ESG n'est en aucune façon financé, approuvé, vendu ou promu par Trucost ou ses sociétés affiliées (conjointement les « Parties du Donneur de licence ») et aucune des Parties du donneur de licence ne saurait garantir ou faire valoir de quelque manière

expresse ou implicite, (i) les résultats à obtenir de l'utilisation des données de Trucost dans le rapport, ou (ii) la pertinence des données de Trucost aux fins de laquelle elles sont rattachées au rapport. Aucune des Parties du donneur de licence ne fournit des conseils financiers ou de placement ou des recommandations relativement au rapport. Aucune des Parties du donneur de licence ne saurait être tenue responsable (au titre de négligence ou autrement) envers quiconque des erreurs de données de Trucost, et aucune des Parties du donneur de licence ne saurait être tenue de notifier quiconque des erreurs contenues dans les données.

Sections FactSet mixité Cette publication peut contenir des informations protégées de FactSet (« Informations de FactSet ») qui ne peuvent être reproduites, utilisées, diffusées, modifiées ou publiées de quelque manière que ce soit sans le consentement écrit exprès de FactSet. Les informations de FactSet sont fournies « en l'état » et toutes les représentations et garanties qu'elles soient orales ou écrites, expresses ou tacites (par le régime du droit commun, par statut ou autrement), sont par la présente, exclues et rejetées, dans les mesures extrêmes permises par la loi. Plus particulièrement, en ce qui concerne les informations relatives à FactSet, FactSet décline toute garantie implicite de qualité marchande et de convenance à des fins spécifiques, ni n'en garantit l'exactitude, l'intégrité, l'actualité, la fonctionnalité et/ou la fiabilité. Les informations relatives à FactSet ne sauraient constituer un conseil en investissement et toutes opinions ou affirmations contenues dans une publication incluant des informations FactSet (et/ou les informations FactSet elles-mêmes) ne sauraient représenter les opinions ou croyances de FactSet, ses sociétés affiliées et/ou des entités liées, et/ou de leurs employés respectifs. La société FactSet ne saurait être tenue responsable de tout dommage découlant de l'utilisation, de quelque manière que ce soit, de cette publication ou des informations de FactSet qui pourraient être contenues dans ce document.

© 2024 State Street Corporation. Tous droits réservés. Date d'expiration : 30/04/2025