

State Street Global Screened Managed Volatility Equity Fund

State Street Global
Advisors Luxembourg
SICAV

Fiche produit

30 novembre 2025

Actions

Objectif du fonds

L'objectif du Fonds consiste à générer sur le long terme des rendements moins volatils que les marchés d'actions mondiaux et des performances comparables à ces derniers.

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")

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.

Stratégie d'investissement

La politique d'investissement du Fonds consiste à générer des rendements présentant une volatilité plus faible que la performance du MSCI World Index (Net) (ou tout autre indice déterminé de temps à autre par les Administrateurs pour répliquer dans une large mesure le même marché que l'Indice) tout en restant comparables à ceux de l'Indice sur le long terme.

La politique d'investissement consistera également à sélectionner les titres sur la base de l'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, au travail, à la lutte contre la corruption et aux armes controversées).

Information sur le fonds

| | |
|---------------------|--|
| Catégorie d'actions | [I EUR Portfolio Hedged] Investisseurs institutionnels |
| Indice | MSCI World Index |
| Structure | Investment Company |
| Conforme à UCITS | Oui |
| Domicile | Luxembourg |

Fiche technique

| | |
|-------------------------------|---|
| ISIN | LU1230563964 |
| Valeur liquidative | 12,70 EUR au 28 novembre 2025 |
| Devise | EUR |
| Actif net(en millions) | 375,09 USD au 28 novembre 2025 |
| Date de lancement | 17 octobre 2021 |
| Classification SFDR des fonds | SFDR – Article 8 |
| Style de gestion | Smart Beta |
| Zone | Monde |
| Règlement/livraison | Cycle de règlement des rachats, DD+2 ; Cycle de règlement des souscriptions, DD+2 |
| Délai de notification | 11 h 00 (heure d'Europe centrale) à JN-1 |
| Valorisation | Clôture journalière du marché |
| Swing Factor ¹ | |
| Souscription | 0,02% |
| Rachat | 0,01% |
| Souscription initiale | EUR 3 000 000,00 |
| Souscriptions ultérieures | EUR 1 000,00 |
| Frais de Gestion | 0,38% |
| Actuel TER | 0,48% |
| Frais payés au fonds | Souscription: N/A Rachat: Maximum 2% |

¹ Indicatif à la date de cette fiche informative, sujet à modification

| Performance | | | | | |
|----------------------|--------|------------|--------|-----------|--------|
| | Indice | Fonds Brut | Ecart | Fonds Net | Ecart |
| Annualisé (%) | | | | | |
| 1 An | 13,91 | 8,34 | -5,56 | 7,83 | -6,08 |
| 3 Ans | 16,91 | 7,36 | -9,55 | 6,84 | -10,07 |
| 5 Ans | - | - | - | - | - |
| Depuis début | 9,33 | 6,37 | -2,96 | 5,86 | -3,47 |
| Cumulé (%) | | | | | |
| 1 Mois | 0,13 | 4,76 | 4,63 | 4,72 | 4,59 |
| 3 Mois | 5,75 | 3,70 | -2,04 | 3,56 | -2,19 |
| 1 An | 13,91 | 8,34 | -5,56 | 7,83 | -6,08 |
| 3 Ans | 59,83 | 23,76 | -36,07 | 21,97 | -37,86 |
| 5 Ans | - | - | - | - | - |
| Depuis début | 45,48 | 29,63 | -15,85 | 27,03 | -18,44 |

Calendrier (%)

| | | | | | |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|
| 2025 (YTD) | 16,26 | 13,57 | -2,70 | 13,07 | -3,19 |
| 2024 | 19,89 | 10,46 | -9,43 | 9,93 | -9,96 |
| 2023 | 20,96 | 1,38 | -19,58 | 0,91 | -20,05 |
| 2022 | -17,87 | -2,78 | 15,08 | -3,24 | 14,62 |
| 2021 (partiel) | 5,05 | 4,84 | -0,21 | 4,67 | -0,38 |

Les performances passées constituent une information et ne préjugent pas de l'évolution future.

Investir implique des risques, dont le risque de perte du capital.

Les chiffres de performance contenus dans ce document sont fournis sur une base brute et nette des frais de base. Les chiffres bruts de frais ne reflètent pas la déduction des frais de conseil ou autres susceptibles de réduire le rendement. Les rendements des indices reflètent les gains et pertes en capital, le revenu et le réinvestissement des dividendes. La performance comprend le réinvestissement des dividendes et les autres bénéfices des entreprises, et est calculée dans la devise indiquée dans la fiche détaillée du fonds.

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.

La méthode de calcul des rendements en valeur ajoutée peut faire apparaître des écarts d'arrondis.

Lorsque le Fond est fermé conformément à son calendrier officiel concernant la Valeur liquidative (VL), mais avec 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.

Avant le 30 April 2025, le Fonds s'appelait State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund.

Avant le 3 juin 2024, l'indice du fonds était le MSCI WORLD EX UNGC AND CW 100% HEDGED TO EUR INDEX.

Source: State Street Investment Management.

Toutes les données sont au 30/11/2025

Caractéristiques

| | Fonds | Indice |
|---|------------|-------------|
| Capitalisation moyenne pondérée (millions) | US\$98 106 | US\$915 192 |
| Ratio moyen cours/valeur comptable | 2,80 | 3,71 |
| Ratio moyen cours/bénéfices | 18,86 | 23,80 |
| Ratio moyen harmonique pondéré cours/flux de trésorerie | 11,22 | 14,07 |
| Rendement de dividende (%) | 2,50 | 1,58 |
| Nombre de Lignes* | 179 | 1,321 |

* Le nombre de titres peut aussi inclure les positions de cash.

| Ratios | 3 Ans |
|---------------------|-------|
| Ecart type (%) | 8,46 |
| Erreur de suivi (%) | 9,95 |
| Bêta | 0,39 |

| 10 Premières Participations | Poids (%) |
|-----------------------------|-----------|
| CISCO SYSTEMS INC | 1,32 |
| JOHNSON & JOHNSON | 1,30 |
| MCKESSON CORP | 1,27 |
| CARDINAL HEALTH INC | 1,25 |
| CENCORA INC | 1,21 |
| ATMOS ENERGY CORP | 1,15 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 1,13 |
| AEON CO LTD | 1,11 |
| WALMART INC | 1,09 |
| PEPSICO INC | 1,09 |

Répartition sectorielle

| | Fonds (%) | Indice (%) |
|-------------------------------------|---------------|---------------|
| Biens de consommation non-cycliques | 24,42 | 5,40 |
| Santé | 23,00 | 9,92 |
| Services de Communication | 12,81 | 8,94 |
| Sociétés financières | 11,83 | 16,43 |
| Services aux collectivités | 8,92 | 2,67 |
| Industrie | 5,68 | 10,94 |
| Energie | 5,20 | 3,37 |
| Technologies de l'info | 3,22 | 27,33 |
| Biens de consommation cycliques | 2,46 | 10,00 |
| Immobilier | 1,43 | 1,85 |
| Matériaux | 1,03 | 3,13 |
| Total | 100,00 | 100,00 |

Répartition par pays

| | Fonds (%) | Indice (%) |
|--------------|---------------|---------------|
| Etats-Unis | 68,09 | 72,51 |
| Japon | 6,99 | 5,47 |
| Suisse | 5,30 | 2,29 |
| Canada | 4,09 | 3,34 |
| Hong Kong | 3,48 | 0,50 |
| Singapour | 3,27 | 0,42 |
| Israël | 3,09 | 0,25 |
| Allemagne | 1,00 | 2,32 |
| Finlande | 0,98 | 0,27 |
| Royaume-Uni | 0,96 | 3,58 |
| Autres | 2,74 | 9,05 |
| Total | 100,00 | 100,00 |

Source: State Street Investment Management.

Les caractéristiques, positions, allocations par pays et secteurs représentés le sont à la date indiquée en haut de la fiche produit et sont susceptibles de changer.

Dans l'allocation par pays, le terme « Autre » désigne la consolidation de tous les pays qui ne sont pas déjà inclus dans le top 10 du Compartiment.

Veuillez noter que le détail complet des participations sous-jacentes du fonds se trouve sur statestreet.com/im.

Nous contacter

Visitez notre site web statestreet.com/im ou contactez un bureau State Street Investment Management.

Belgium

+32 (0) 2 663 2016

Middle East & Africa

+971 2 245 9000

France

+33 (0) 1 44 45 40 48

Netherlands

+31 (0) 20 718 1701

Germany

+49 (0) 89 55878 999

Switzerland

+41 (0) 44 245 7099

Ireland

+353 (1) 776 3000

United Kingdom

+44 (0) 20 3395 2333

Italy

+39 02 3206 6121

statestreet.com/im

Communiqué commercial

Accès général. À l'usage exclusif des clients professionnels.

State Street Global Advisors (SSGA) porte désormais le nom de State Street Investment Management. Veuillez consulter statestreet.com/investment-management pour plus d'informations.

Ce document sert à des fins d'informations privées. 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) ou dans la réglementation suisse applicable et elles ne doivent pas être invoquées en tant que telles. Il

n'y a aucune représentation ou garantie quant à l'exactitude de ces informations et State Street décline toute responsabilité vis-à-vis des décisions fondées sur celles-ci.

Veuillez consulter la dernière mise à jour du Document d'information clé (DIC)/ Document d'information clé pour l'investisseur (DICI) et du Prospectus du Fonds avant toute décision d'investissement. Les versions anglaises les plus récentes du Prospectus et du DIC/DICI sont consultables à l'adresse [www.statestreet.com/im](http://statestreet.com/im). Une synthèse des droits des investisseurs est disponible ici : <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights/ssga-investors-rights-summary-template-non-etf-Lux.pdf> Veuillez noter que la Société de gestion peut décider de mettre fin aux dispositions relatives à la commercialisation et procéder à la

dénomination conformément à l'art. 93a de la directive 2009/65/CE.

Cette communication est destinée aux clients professionnels (ce qui inclut les Contreparties éligibles) qui sont considérés comme à la fois compétents et expérimentés en matière d'investissements.

Les informations contenues dans le présent document ne constituent pas une recommandation basée sur des travaux de recherche ou un produit de recherche d'investissement » et sont considérées comme une « communication marketing » en vertu de la réglementation régionale applicable. Cette communication marketing (a) n'a donc pas été préparée conformément aux dispositions légales visant à promouvoir l'indépendance de la recherche en investissement et (b) n'est de ce fait soumise à aucune disposition interdisant la négociation préalable à la

diffusion de recherche en investissement.

Ce travail ne saurait être reproduit, copié ou transmis en tout ou partie, ni son contenu communiqué à des tiers sans l'autorisation expresse écrite de SSGA.

Les marques de commerce mentionnées dans les présentes appartiennent à leurs propriétaires respectifs. Les fournisseurs de données tiers ne donnent aucune garantie ni ne formulent aucune déclaration de quelque sorte que ce soit quant à l'exactitude, l'exhaustivité ou l'actualité des données et ne sauraient être tenus responsables d'aucun préjudice de quelque nature qu'il soit relatif à l'utilisation desdites données.

© 2025 State Street Corporation.
Tous droits réservés.
Date d'expiration : 19/01/2026