

SSGA SPDR ETFs Europe II Plc
1 avril 2025

SPDR MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF

Supplément N° 53

(Un compartiment de SSGA SPDR ETFs Europe II plc (la « Société »), société d'investissement de type ouvert constituée en fonds parapluie avec responsabilité séparée entre les compartiments, agréée par la Banque centrale d'Irlande en vertu de la Réglementation OPCVM).

Le présent Supplément (le « Supplément ») fait partie du Prospectus en relation avec la Société, daté du 1 avril 2025 et amendé le cas échéant (le « Prospectus »). Ce Supplément doit être lu conjointement au Prospectus et au Document d'informations clés relatif aux produits d'investissement packagés de détail et fondés sur l'assurance (« DIC relatif aux PRIIP ») ou au Document d'informations clés pour l'investisseur (« DICI »). Il présente les informations relatives au compartiment SPDR MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF (le « Compartiment »), représenté dans la Société par les séries d'actions SPDR MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF (les « Actions »).

Toutes les Actions de ce Compartiment ont été désignées comme Actions ETF. À moins qu'ils ne soient définis différemment aux présentes ou que le contexte ne l'exige autrement, tous les termes utilisés dans le présent Supplément seront réputés avoir la même signification que dans le Prospectus.

Les éventuels investisseurs sont invités à étudier attentivement et intégralement le Supplément, le Prospectus et le DIC relatif aux PRIIP ou le DICI. Pour toute question, nous vous recommandons de consulter votre courtier ou votre conseiller financier. Les investisseurs potentiels sont invités à prendre connaissance des facteurs de risque décrits dans le Prospectus et dans le présent Supplément avant d'investir dans ce Compartiment. La Société et les Administrateurs listés à la section du Prospectus intitulée « Direction de la Société » assument la responsabilité des informations contenues dans le présent Supplément.

Caractéristiques du Compartiment

Devise de référence	EUR.
Gestionnaire d'investissement	State Street Global Advisors Europe Limited.
Gestionnaire(s) d'investissement par délégation	State Street Global Advisors Limited.
Politique en matière de dividendes	<p>Pour les catégories d'actions de distribution, à distribution semestrielle du revenu (aux environs de juin et décembre), sauf lorsque la Société de gestion décide, à son entière discréTION, de ne pas verser de dividende à une date de distribution donnée.</p> <p>Pour les catégories d'actions de capitalisation, l'ensemble des revenus et plus-values sera cumulé dans la Valeur liquidative par Action. Le statut de distribution ou de capitalisation est indiqué page suivante, parmi les renseignements sur la catégorie d'actions.</p>
Classification du Compartiment selon le Règlement SFDR	Article 8 Risque en matière de durabilité du Compartiment intégré par l'Indice.

Informations relatives aux négociations

Échéance de négociation	<p>Pour les souscriptions et rachats en numéraire de catégories d'actions non couvertes : 14 h 30 (heure irlandaise), chaque Jour de négociation.</p> <p>Pour les souscriptions et rachats en numéraire de catégories d'actions couvertes : 14 h (heure irlandaise), chaque Jour de négociation.</p> <p>Pour l'ensemble des souscriptions et des rachats en numéraire effectués le dernier Jour de négociation précédent le 25 décembre et le 1^{er} janvier de chaque année : 11 h (heure irlandaise).</p> <p>La Société de gestion pourra déterminer des dates antérieures ou ultérieures à sa discréTION, à condition d'avoir notifié les Participants agréés au préalable.</p> <p>Les Actionnaires ne sont pas autorisés à effectuer des règlements en nature.</p>
Date limite de règlement	15 h (heure irlandaise), le deuxième Jour ouvrable consécutif au Jour de négociation, ou toute autre date antérieure ou ultérieure déterminée le cas échéant par la Société de gestion. La Société de gestion/la Société notifiera les Actionnaires si, (i) une Date de règlement anticipée s'applique au regard des souscriptions, ou (ii) une Date de règlement différée s'applique au regard des rachats. Les règlements peuvent être impactés par le calendrier de règlement des marchés sous-jacents.
VL de négociation	La Valeur liquidative par Action est calculée au Point de valorisation du Jour de négociation concerné.
Montant minimum de Souscription et de Rachat	Les Participants agréés sont invités à se référer aux Directives opérationnelles pour les Participants agréés, pour tous détails sur les montants minimums actuels de souscription et de rachat du Compartiment.

Informations sur l'Indice

Indice (Ticker)	MSCI Europe Climate Paris Aligned Index (MXERCLNE).
Fréquence de rééquilibrage de l'Indice	Semestrielle.
Informations complémentaires sur l'Indice	<p>Les détails complémentaires relatifs à l'Indice et à sa performance sont consultables sur :</p> <p>https://www.msci.com/constituents</p> <p>https://www.msci.com/documents/10199/688d56f7-4ea0-1e44-7b7e-39d0545d65e9</p> <p>https://www.msci.com/equity-research/methodology/meth_docs/MSCI_Climate_Paris_Aligned_Indexes.pdf</p>

Informations sur la valorisation

Valorisation	La Valeur liquidative par Action est calculée conformément aux dispositions stipulées sous la section « Détermination de la Valeur liquidative » du Prospectus.
Cours de valorisation utilisés	Dernier cours négocié.
Point de valorisation	18 h 45 (heure irlandaise), chaque Jour ouvrable.

SPDR MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF

Catégories d'actions

Type de Catégorie d'actions	Non couverte en EUR		Couverte en EUR		Couverte en USD		Couverte en GBP		Couverte en CHF		
Nom	SPDR MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF		SPDR MSCI Europe Climate Paris Aligned EUR Hdg UCITS ETF		SPDR MSCI Europe Climate Paris Aligned USD Hdg UCITS ETF		SPDR MSCI Europe Climate Paris Aligned GBP Hdg UCITS ETF		SPDR MSCI Europe Climate Paris Aligned CHF Hdg UCITS ETF		
Politique en matière de dividendes*	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	
Devise associée à la Catégorie d'actions	EUR		EUR		USD		GBP		CHF		
TFE (pour toute information complémentaire, veuillez vous reporter à la section « Commissions et frais » du Prospectus)	Jusqu'à 0,15 %		Jusqu'à 0,20 %								

* Politique en matière de dividendes : « Acc » = Actions de capitalisation, « Dist » = Actions de distribution

Objectif et politique d'investissement

Objectif d'investissement : L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance des grandes et moyennes entreprises européennes.

Politique d'investissement : La politique d'investissement du Compartiment consiste à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'Indice (ou de tout autre indice déterminé à la discréction des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'Indice), tout en visant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

L'Indice vise à refléter la performance d'un sous-ensemble de titres de participation de sociétés composant l'indice MSCI Europe Index (l'**« Indice parent »**) qui sont sélectionnés et pondérés conformément à la méthodologie de l'Indice en question. La méthodologie de l'Indice vise à réduire l'exposition aux risques induits par la transition vers une économie sobre en carbone et aux risques physiques induits par le changement climatique tout en recherchant les opportunités offertes par cette transition. Elle vise également à aligner le portefeuille du Compartiment sur l'Accord de Paris adopté en vertu de la Convention-cadre des Nations unies sur les changements climatiques (l'**« accord de Paris »**). L'Indice parent mesure la performance des actions de sociétés de grande et moyenne capitalisations des pays développés européens. L'Indice vise à dépasser les seuils de référence minimaux alignés sur l'Accord de Paris établis pour l'UE dans le Règlement délégué de la Commission (UE) 2020/1818 s'appliquant à la méthodologie des indices de référence qui s'alignent sur les objectifs de l'accord de Paris. L'Indice exclut certaines sociétés en raison de leur implication dans les activités commerciales controversées suivantes : armes controversées, tabac, pétrole et gaz, extraction de charbon thermique et production d'énergie thermique au charbon. Les détails complémentaires concernant la définition de ce qui constitue une « implication » sont précisés par le Fournisseur d'indice dans la méthodologie indicelle. L'Indice exclut également les sociétés identifiées par le fournisseur d'indice comme impliquées dans des controverses qui ont une incidence ESG négative sur leurs activités et/ou leurs produits et services, sur la base d'un score de controverse ESG de MSCI (le **« Score de controverse ESG MSCI »**). Le Score de controverse ESG MSCI reflète l'évaluation des controverses établie par le fournisseur d'indice concernant l'incidence environnemental, social et/ou de gouvernance négative des activités d'exploitation, et des produits et services de la société. Le cadre commun d'évaluation utilisé par MSCI pour l'évaluation des controverses ESG est conçu de manière à rester cohérent avec les normes internationales établies dans la Déclaration des droits de l'homme des Nations Unies, la Déclaration relative aux principes et droits fondamentaux au travail de l'OIT et le Pacte mondial des Nations Unies. Le score de controverse ESG de MSCI s'inscrit sur une échelle allant de 0 à 10, la note 0 représentant le niveau de controverse le plus sévère. Les sociétés identifiées par le fournisseur d'indice comme ayant donné lieu à des controverses se rapportant à des questions environnementales sont exclues de l'Indice sur la base du score de controverse environnementale de MSCI (**« Score de controverse environnementale de MSCI »**). Le Score de controverse ESG MSCI minimum et le Score de controverse environnementale MSCI minimum établis par le fournisseur

d'indice pour déterminer l'admissibilité des titres à l'inclusion dans l'Indice peuvent être consultés sur le site Internet du fournisseur d'indice <https://www.msci.com/index-methodology>.

Les composantes restantes sont alors sélectionnées et pondérées en vue de leur inclusion dans l'Indice de manière à réduire l'exposition aux risques induits par la transition vers une économie sobre en carbone et aux risques physiques induits par le changement climatique et d'identifier les opportunités offertes par cette transition tout en cherchant à s'aligner sur les objectifs de l'accord de Paris et en minimisant l'écart de suivi ex ante par rapport à l'Indice parent. À ce stade, la méthodologie de l'Indice :

(i) applique certaines contraintes au niveau de l'indice qui :

- visent à réduire l'intensité globale des émissions de gaz à effet de serre (GES) par rapport à celle de l'Indice parent ;
- visent un taux de décarbonation minimum en termes de réduction d'émissions GES, par an ;
- visent une exposition à des secteurs ayant un impact élevé sur le changement climatique au moins équivalent à celle de l'Indice parent pour s'aligner sur les objectifs de l'accord de Paris et inclure les secteurs qui devraient activement réduire leurs émissions GES ; et

(ii) prennent en compte :

- une exposition accrue aux sociétés qui publient leurs objectifs de réduction d'émissions, leur volume d'émissions annuel et qui réduise leur intensité en GES ;
- une contribution à la réduction de l'intensité potentielle moyenne pondérée par rapport à celle de l'Indice parent ;
- une contribution à l'augmentation du score de transition vers une économie sobre en carbone (« TBC », pour transition bas carbone) global par rapport à celui de l'Indice parent (c'est-à-dire, une exposition globale plus faible aux sociétés faisant face à des risques induits par la TBC et/ou une exposition globale plus élevée aux sociétés susceptibles de saisir des opportunités offertes par la TBC) tel que déterminé par le fournisseur d'indice ;
- une réduction de l'exposition aux risques physiques induits par des événements climatiques extrêmes par rapport à celle de l'Indice parent ;
- une contribution à l'exposition globale accrue aux sociétés présentant une part verte à brune de leur chiffre d'affaires minimum par rapport à celle des sociétés composant l'Indice parent ; sachant que les revenus verts reflètent ceux provenant de produits et services susceptibles de contribuer à la transition vers une économie à faible intensité en carbone par opposition aux revenus bruns susceptibles de causer un préjudice à l'environnement et entraver la transition en question (pour plus d'informations sur la définition et le calcul des revenus verts et bruns, veuillez consulter la méthodologie de l'indice) ;
- une contribution accrue à la part verte du chiffre d'affaires globale par rapport à celle l'Indice parent ; et
- la liquidité au niveau de chaque composante et des plafonds de diversification,

selon les seuils de contraintes déterminés par le fournisseur d'indice dans la méthodologie de l'indice.

L'adoption de ce processus de filtrage au sein de l'Indice correspond aux facteurs environnementaux et sociaux que le Compartiment promeut, comme décrit plus en détail dans la sous-section « **Filtrage ESG** » de la section « **Investissement ESG** » du Prospectus. Les Sociétés qui ne sont pas exclues par le Fournisseur d'indice sur la base de leur Score de controverse ESG MSCI sont considérées faire preuve de bonne gouvernance. Les principales limites fixées dans la méthode sont décrites dans la sous-section « **Risque lié au filtrage** » de la section « **Risques d'investissement** » du présent Supplément.

Le filtrage ESG s'applique à au moins 90 % du portefeuille.

Le portefeuille du Compartiment est principalement composé de titres conformes aux normes ESG mentionnées ci-dessus et dans la méthodologie indicelle (et qui garantissent que le portefeuille soit exempt d'émetteurs dont les activités seraient considérablement préjudiciables à cet objectif).

Les composantes de l'Indice peuvent parfois être rééquilibrées plus souvent que la Fréquence de rééquilibrage si la méthodologie de l'Indice le requiert, y compris par exemple lorsque des opérations d'entreprises telles que des fusions ou acquisitions affectent les composantes de l'Indice.

L'Indice est généralement bien diversifié, mais, du fait du marché qu'il reflète, il peut inclure en fonction de la conjoncture des sous-jacents émis par le même organisme qui sont susceptibles de représenter plus de 10 % de l'Indice. Aux fins de répliquer l'Indice avec précision, le Compartiment utilisera les limites de diversification accrues disponibles au titre de la Règle 71 de la Réglementation OPCVM. Ces limites autorisent le Compartiment à détenir des positions sur des sous-jacents individuels de l'Indice émis par le même organisme à hauteur de 20 % de sa Valeur liquidative.

Les Catégories d'actions couvertes sont disponibles pour réduire l'impact des fluctuations des taux de change entre la devise de la Catégorie et la devise de libellé des actifs sous-jacents. Les investisseurs sont avisés que les Catégories d'actions couvertes (ainsi désignées dans le présent Supplément) seront couvertes dans la devise de la Catégorie concernée. Par conséquent, les Catégories d'actions couvertes devraient répliquer plus fidèlement les versions correspondantes de l'Indice couvert contre le risque de change.

Le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation investiront pour le compte du Compartiment, selon la stratégie de réplication décrite plus en détail sous la section « **Objectifs et politiques d'investissement – Fonds indiciaux** » du Prospectus, essentiellement dans des titres de l'Indice, toujours conformément aux Restrictions d'investissement stipulées dans le Prospectus. Le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation peuvent également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice mais qu'ils jugent refléter fidèlement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Les titres de capital dans lesquels le Compartiment investit seront principalement cotés ou négociés sur des Marchés reconnus, conformément aux limites stipulées dans la

Réglementation OPCVM. Les détails relatifs au portefeuille du Compartiment et à la valeur liquidative indicative par Action du Compartiment sont disponibles quotidiennement sur le site Internet.

À la date de ce Supplément, le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation examinent les principales incidences négatives de leurs décisions d'investissement au niveau du Compartiment afin de chercher à réduire les externalités négatives susceptibles d'être causées par leurs investissements sous-jacents.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales ou sociales conformément à l'article 8 du Règlement SFDR. Des informations complémentaires concernant les caractéristiques environnementales et sociales figurent dans l'annexe à ce Supplément.

Opérations de couverture de change : Le Compartiment utilisera des instruments financiers dérivés (« **IFD** »), y compris des contrats de change à terme, pour couvrir une partie ou l'intégralité du risque de change pour les Catégories d'actions couvertes. Les opérations de couverture contre le risque de change, concernant une Catégorie d'actions couverte, seront clairement attribuables à cette Catégorie et les coûts seront imputables uniquement à cette Catégorie. Tous les coûts et engagements correspondants et/ou les bénéfices seront comptabilisés dans la valeur liquidative par Action de la Catégorie. Certaines positions peuvent s'avérer excessivement ou insuffisamment couvertes, ceci de manière involontaire et en raison de facteurs indépendants de la volonté du Gestionnaire d'investissement et/ou du Gestionnaire d'investissement par délégation, mais elles seront surveillées et ajustées régulièrement.

Règlement taxinomie : Bien que ce Compartiment promeuve des caractéristiques environnementales au sens de l'Article 8 du SFDR, il ne s'est pas pour l'heure actuelle engagé à investir dans des « placements durables » au sens du Règlement taxinomie. L'expression « ne cause pas de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents du Compartiment qui prennent en compte les critères de l'UE concernant les activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents de la portion restante de ce Compartiment ne tiennent pas compte des critères de l'UE concernant des activités économiques écologiquement durables. Le Compartiment s'engage à ne pas investir plus de 0 % de sa Valeur liquidative dans des investissements alignés sur le Règlement taxinomie.

Investissements autorisés

Actions : Les titres dans lesquels le Compartiment investit peuvent inclure des actions, ou des titres liés à des actions tels que les Certificats de dépôt américains (ADR) ou les Certificats de dépôt internationaux (GDR). Les ADR et GDR sont généralement substitués aux actions locales lorsque la détention des actions locales représentées dans l'Indice est impossible ou que son coût est prohibitif.

Autres Fonds/Actifs liquides : Le Compartiment peut investir jusqu'à 10 % de ses actifs nets dans d'autres fonds réglementés de type ouvert (y compris des Fonds monétaires) lorsque les objectifs de ces fonds sont conformes à l'objectif du Compartiment et lorsque ces fonds sont agréés dans des États membres de l'EEE, au Royaume-Uni, aux États-Unis, à Jersey, Guernesey, l'Île de

Man, et lorsqu'ils satisfont aux dispositions fondamentales de la Réglementation OPCVM. Le Compartiment peut détenir des actifs liquides à titre accessoire tels que des dépôts, conformément à la Réglementation OPCVM.

Dérivés : Le Compartiment peut utiliser des IFD à des fins de couverture de change et de gestion efficace de portefeuille. L'utilisation d'IFD par le Compartiment sera limitée aux contrats à terme standardisés et aux contrats de change à terme (dont des contrats de change à terme non livrables), ainsi qu'aux bons de souscription. La gestion efficace de portefeuille suppose des décisions d'investissement impliquant des transactions souscrites dans l'un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : réduire les risques ; réduire les coûts ; générer une augmentation du capital ou du revenu pour le Compartiment avec un niveau de risque adéquat, en tenant compte du profil de risque du Compartiment ; ou minimiser l'écart de suivi, c'est-à-dire le risque que le rendement du Compartiment diffère de celui de l'Indice. Les IFD sont décrits à la section « **Objectifs et politiques d'investissement – Utilisation des Instruments financiers dérivés** » du Prospectus.

Prêt de titres, Contrats de mise en pension et Contrats de prise en pension

Le Compartiment ne participe actuellement pas au programme de prêts de titres, bien qu'il y soit habilité. Le Compartiment ne prévoit également pas de souscrire de contrats de mise en pension ni de contrats de prise en pension de titres. Si les Administrateurs viennent à modifier cette politique à l'avenir, les Actionnaires en seront dûment informés par notification et le présent Supplément sera actualisé en conséquence.

Risques d'investissement

Investir dans le Compartiment implique un certain degré de risque. Les investisseurs sont invités à consulter la section du Prospectus intitulée « **Informations relatives aux risques** ». Par ailleurs, les risques suivants concernent particulièrement le Compartiment.

Risque indiciel : Le rendement du Compartiment peut ne pas correspondre au rendement de l'Indice. Il est actuellement prévu que le Compartiment répliquera l'Indice avec une possible variation annuelle à hauteur de 1 % dans des conditions de marché normales. La capacité du Compartiment à répliquer l'Indice sera affectée par les charges du Compartiment, par le volume de trésorerie et d'équivalents de trésorerie détenus dans son portefeuille, et par la fréquence et le calendrier des acquisitions et des ventes d'intérêts dans le Compartiment. Le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation peuvent tenter de répliquer le rendement de l'Indice en investissant dans un sous-ensemble de titres inclus dans l'Indice, ou dans certains titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, ce qui peut augmenter le risque de divergence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice.

Risque de liquidité et Risque de liquidité lié aux ETF : L'absence d'un marché actif ou les restrictions de vente peuvent limiter la capacité du Compartiment à vendre un titre à un moment ou cours avantageux, voire rendre la vente du titre complètement impossible. Des titres illiquides peuvent

être négociés avec une décote par rapport à des investissements comparables plus liquides et être soumis à de fortes fluctuations de leur valeur de marché. L'illiquidité des participations du Compartiment peut limiter sa capacité à obtenir du numéraire pour effectuer les rachats au moment opportun. Lorsque le Compartiment investit dans des titres illiquides ou que les volumes négociés ne sont pas importants, les écarts entre l'offre et la demande peuvent s'accroître et le Compartiment peut se retrouver exposé à une augmentation du risque de valorisation et à une réduction de sa capacité à négocier. Les Actions du Compartiment peuvent aussi s'échanger à des cours différant substantiellement de la dernière VL disponible.

Risque associé aux produits et instruments dérivés : Le Compartiment peut utiliser des IFD à des fins de gestion efficace de portefeuille, comme stipulé au paragraphe « **Instrument dérivés** » de la section relative aux Investissements autorisés ci-dessus. L'utilisation d'IFD par le Compartiment implique des risques différents, voire plus élevés, par rapport à ceux associés aux investissements directs dans des titres.

Risque lié au filtrage : Il existe un risque que le Fournisseur d'indice puisse faire des erreurs, telles que l'évaluation incorrecte des critères de présélection décrits dans la Politique d'investissement et/ou l'inclusion/l'exclusion des bons composants dans le processus de filtrage. Les systèmes de notation et de filtrage ESG présentent des limites inhérentes à la méthodologie. Toute évaluation des critères ESG par un Indice est basée sur les données fournies par des tiers. Ces évaluations dépendent d'informations et de données qui peuvent être incomplètes, inexactes ou non disponibles, ce qui pourrait entraîner une évaluation incorrecte des performances ESG d'un émetteur. Ils peuvent notamment contenir des erreurs ou incohérences éventuelles ou ne pas disposer de toutes les données ESG nécessaires surtout lorsque celles-ci sont relevées par des fournisseurs externes. Ces limites peuvent, entre autres, porter sur :

- l'absence ou l'insuffisance des données (par exemple, des informations concernant la capacité des sociétés à gérer les risques en matière de durabilité) introduites dans le modèle de filtrage ;
- la quantité et la qualité des données ESG à traiter ;
- l'identification de facteurs pertinents pour l'analyse ESG.

Intégration du Risque en matière de durabilité : L'intégration du Risque en matière de durabilité par l'Indice ne garantit pas l'atténuation d'un ou de tous les Risques en la matière. Toute détérioration du profil financier d'un investissement sous-jacent affecté par un Risque en matière de durabilité peut avoir une incidence négative correspondante sur la Valeur liquidative et/ou la performance du Compartiment procédant à l'investissement.

Risque de classification du Fonds selon le Règlement SFDR : Le Règlement SFDR a été mis en œuvre progressivement à partir du 10 mars 2021 et impose de nouvelles obligations de divulgation aux acteurs des marchés financiers. À la date du présent Prospectus, les Normes techniques de réglementation (Niveau 2) du Règlement SFDR ont été adoptées par la Commission européenne et seront applicables à compter du

1^{er} janvier 2023, mais certains concepts introduits par ledit Règlement ne font pour l'instant pas l'objet de normes techniques d'exécution centralisées, d'orientations locales ou de pratiques de marché établies. Le Compartiment a été évalué et classé de bonne foi sur la base des informations pertinentes actuellement disponibles. Au fur et à mesure de l'évolution de ces normes et directives, les divulgations connexes du Règlement SFDR et la classification aux termes de son article 8 indiquées dans le présent Prospectus et sur le site Internet sont susceptibles de changer et de ne plus s'appliquer.

Risque associé à la Catégorie d'actions : Il n'existe pas de séparation des engagements entre les Catégories du Compartiment. Même si le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation cherchent à s'assurer que les plus-values/moins-values et les coûts afférents à l'IFD concerné, en lien avec toute stratégie de couverture de change, n'augmentent que pour la Catégorie prévue, les transactions peuvent donner lieu à des engagements concernant d'autres Catégories.

Risque lié aux opérations de couverture de change : Les opérations de couverture sont parfois soumises à une mauvaise adéquation entre l'opération de couverture et le risque que l'on cherche à couvrir. Il ne peut être garanti que les opérations de couverture du Compartiment seront efficaces. Étant donné que les opérations de couverture contre le risque de change ont pour but de tenter de réduire ou d'éliminer les pertes occasionnées par les fluctuations des taux de change, elles peuvent également réduire ou éliminer les plus-values en cas d'appréciation de la devise de libellé des actifs du Compartiment.

Profil de l'investisseur

Les investisseurs types du Compartiment sont généralement des investisseurs institutionnels, intermédiaires et particuliers, désireux de prendre une exposition moyenne ou longue à la performance des grandes et moyennes entreprises des marchés développés d'Europe, et prêts à accepter les risques associés aux investissements de ce type ainsi que la forte volatilité prévisionnelle du Compartiment.

Souscription, rachats et conversions

Les investisseurs peuvent souscrire ou racheter les Actions du Compartiment chaque Jour de négociation à la VL de négociation assortie d'une provision adéquate pour Droits et charges et conformément aux dispositions stipulées à la section « **Informations sur l'achat et la vente** » du Prospectus.

Concernant les souscriptions, la contrepartie doit être reçue à la Date limite de règlement applicable sous forme d'espèces. Pour les rachats, une demande de rachat écrite signée par l'Actionnaire doit être réceptionnée par l'Agent administratif avant l'Échéance de négociation au Jour de négociation concerné. Les Actionnaires ne sont pas autorisés à effectuer des règlements en nature.

Les Actionnaires sont invités à consulter les conditions indiquées sous la section « **Informations sur l'achat et la vente** » du Prospectus pour toute information sur les conversions d'Actions.

Période d'offre initiale

Les Actions du Compartiment qui ne sont pas lancées à la date du présent Supplément seront disponibles de 9 h (heure irlandaise) le 2 avril 2025 à 15 h (heure irlandaise) le 1 octobre 2025, ou toute autre date antérieure ou postérieure déterminée à la discrétion des Administrateurs et notifiée à la Banque centrale (la « Période d'offre initiale »). Le prix d'offre initial sera d'environ 10 dans la devise de la catégorie d'actions respective, majoré d'une provision adéquate pour Droits et charges, ou de tout autre montant déterminé par le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation et communiqué aux investisseurs avant l'investissement. Après clôture de la Période d'offre initiale, les Actions seront émises à la VL de négociation.

Annexe SFDR

ANNEXE II

Modèle d'informations précontractuelles pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne dresse pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit : SPDR MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF (le « Compartiment »)

Identifiant d'entité juridique :
549300P6VW2EPP0OXG41

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

- | | |
|--|---|
| <p><input type="checkbox"/> Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %</p> <p><input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p><input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p><input type="checkbox"/> ayant un objectif social</p> <p><input type="checkbox"/> Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : ___ %</p> | <p><input type="checkbox"/> Il promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien que son objectif ne porte pas sur l'investissement durable, il présentera une proportion minimale de 0 % d'investissements durables</p> <p><input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p><input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p><input type="checkbox"/> Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables</p> |
|--|---|

Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

Le Compartiment promeut les caractéristiques environnementales et/ou sociales établies par l'indice qu'il réplique, à savoir le MSCI Europe Climate Paris Aligned Index (l'« Indice »). L'Indice vise à refléter la performance d'un sous-ensemble de titres de participation de sociétés au sein de l'indice MSCI Europe Index (l'« Indice parent »), afin de réduire son exposition aux risques de transition et risques physiques climatiques, tout en poursuivant les opportunités nées de la transition vers une économie moins carbonée, et tâche de s'aligner sur les exigences de l'accord de Paris adopté au titre de la Convention-cadre des Nations unies sur les changements climatiques (l'« Accord de Paris »).



Les indicateurs de durabilité évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?

La réalisation des caractéristiques concernées est évaluée au moyen des indicateurs décrits ci-dessous. Les objectifs de l'Indice sont les suivants :

- la réduction de l'intensité globale des gaz à effet de serre (GES) par rapport à l'Indice parent ;
- un taux de décarbonation minimum, en termes de réduction de l'intensité des GES par an ; et
- une exposition aux secteurs à fort impact sur le changement climatique au moins équivalente à l'Indice parent afin de s'aligner sur les objectifs de l'accord de Paris pour inclure les secteurs qui devraient activement réduire les émissions de GES.

L'indice prend en considération :

- l'exposition accrue aux sociétés qui publient des objectifs de réduction d'émissions, publient leurs émissions annuelles et réduisent leur intensité des émissions de GES ;

- la contribution à la réduction de l'intensité moyenne pondérée des émissions potentielles par rapport à l'Indice parent ;
- la contribution à l'augmentation du score de transition bas-carbone (*Low Carbon Transition, LCT*) d'ensemble par rapport à celui de l'Indice parent (c.-à-d., une exposition globale plus faible aux entreprises confrontées aux risques de la LCT et/ou une exposition globale plus élevée aux entreprises qui peuvent bénéficier des opportunités de la LCT), comme déterminé par le fournisseur d'indice ;
- la réduction de l'exposition au risque physique résultant d'événements climatiques extrêmes par rapport à celle de l'Indice parent ;
- la contribution à l'augmentation de l'exposition globale aux sociétés dotées d'un ratio de revenus verts/bruns minimum par rapport à celle de l'Indice parent, sachant que les revenus verts reflètent les revenus qu'une société tire de produits et de services qui ont le potentiel de contribuer à la transition bas-carbone, par opposition aux revenus bruns susceptibles d'être préjudiciables à l'environnement et d'aggraver la transition bas-carbone (pour davantage d'informations sur la signification des revenus verts et bruns et leur mode de calcul, veuillez vous référer à la méthodologie indicelle) ;
- la contribution à l'augmentation du revenu vert global par rapport à l'Indice parent ; et
- les plafonds de liquidité et de diversification au niveau des composantes.

Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend partiellement réaliser et comment l'investissement durable contribue-t-il à ces objectifs ?

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend partiellement réaliser ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Non applicable

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Non applicable

Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Non applicable

Les principales incidences négatives
correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Oui,



Le Compartiment vise à réduire les externalités négatives causées par les investissements sous-jacents et, dans ce contexte, examine les Principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de durabilité en appliquant des filtres ESG basés sur des normes au sein de l'indice. Plus précisément, le Compartiment prend en considération :

- la violation des principes du PMNU
- l'exposition à des armes controversées

De plus amples informations sur les PIN sont consultables dans les Rapports périodiques du Compartiment.

Non

Quelle stratégie d'investissement ce produit financier suit-il ?

La politique d'investissement du Compartiment consiste à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'Indice (ou de tout autre indice déterminé à la discrédition des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'Indice), tout en visant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

L'Indice vise à refléter la performance d'un sous-ensemble de titres de participation de sociétés au sein de l'Indice parent, lesquels sont sélectionnés et pondérés conformément à sa méthodologie. La méthodologie de l'Indice vise à réduire l'exposition du Compartiment aux risques de transition et risques physiques climatiques, tout en poursuivant les opportunités nées de la transition vers une économie moins carbonée et en tâchant d'aligner le portefeuille du Compartiment sur les exigences de l'Accord de Paris adopté au titre de la Convention-cadre des Nations unies sur les changements climatiques. L'Indice parent mesure la performance des actions de sociétés de grande et moyenne capitalisation de l'ensemble des marchés développés en Europe. L'Indice vise à dépasser les seuils de référence minimaux alignés sur l'Accord de Paris établis pour l'UE dans le Règlement délégué de la Commission (UE) 2020/1818 s'appliquant à la méthodologie des indices de référence qui s'alignent sur les objectifs de l'accord de Paris. L'Indice exclut certaines sociétés en raison de leur implication dans les activités commerciales controversées suivantes : armes controversées, tabac, pétrole et gaz, extraction de charbon thermique et production d'énergie thermique au charbon. Les détails complémentaires concernant la définition de ce qui constitue une « implication » sont précisés par le Fournisseur d'indice dans la méthodologie indicelle. L'Indice exclut également les sociétés identifiées par le Fournisseur d'indice comme impliquées dans des controverses qui ont une incidence ESG négative sur leurs activités et/ou leurs produits et services, sur la base d'un score de controverse ESG de MSCI (le « Score de controverse ESG MSCI »).

Le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation investiront pour le compte du Compartiment, selon la stratégie de réplication décrite plus en détail sous la section « Objectifs et politiques d'investissement – Fonds indicuels » du Prospectus, essentiellement dans des titres de l'Indice, toujours conformément aux Restrictions d'investissement stipulées dans le Prospectus.

Quels sont les éléments contraignants de la stratégie d'investissement utilisés pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?

La politique d'investissement du Compartiment consiste à reproduire la performance de l'Indice. Le Compartiment investit au moins 90 % de ses actifs dans des titres qui composent l'Indice, tandis que le Fournisseur d'indice applique des notations ESG à toutes les composantes de l'Indice. L'Indice exclut certaines sociétés en raison de leur implication dans les activités commerciales controversées suivantes : armes controversées, tabac, pétrole et gaz, extraction de charbon thermique et production d'énergie thermique au charbon. Les détails complémentaires concernant la définition de ce qui constitue une « implication » sont précisés par le Fournisseur d'indice dans la méthodologie indicelle. L'Indice exclut également les sociétés identifiées par le Fournisseur d'indice comme impliquées dans des controverses qui ont une incidence ESG négative sur leurs activités et/ou leurs produits et services, sur la base d'un score de controverse ESG de MSCI (le « Score de controverse ESG MSCI »).

Quel est le taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement ?

Le Compartiment exclut les investissements dans les émetteurs tels que définis dans la stratégie d'investissement et les exigences contraignantes décrites ci-dessus, mais ne définit pas pour autant un taux minimal d'engagement à réduire la portée des investissements.

Quelle est la politique suivie pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés bénéficiaires des investissements ?

Les sociétés que le Fournisseur d'indice juge ne pas contrevenir aux principes du PMNU sont réputées faire preuve de bonne gouvernance. Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indicelle de MSCI qui peut être consulté sur le lien suivant :

https://www.msci.com/eqb/methodology/meth_docs/MSCI_Climate_Paris_Aligned_Index es.pdf

Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

Les caractéristiques environnementales et sociales sont promues via l'adoption de filtres et de critères « best-in-class » au sein de l'Indice.

Le Compartiment investit au moins 90 % de ses actifs dans des titres qui composent l'Indice et sont alignés sur des caractéristiques environnementales et/ou sociales, tandis que le Fournisseur d'indice applique des notations ESG à toutes les composantes de l'Indice. Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement sur la taxinomie. Le Compartiment peut détenir 10 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou équivalents de trésorerie et de dérivés utilisés à des fins de couverture de change et de gestion efficace de portefeuille, à la discrédition du Gestionnaire d'investissement, qui seraient classés sous la catégorie « #2 Autres » dans le tableau ci-dessous. Ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'y aura de garanties environnementale ou sociale en place.

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement taxinomie de l'UE.

Le portefeuille du Compartiment est principalement composé de titres qui satisfont aux

La stratégie d'investissement guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

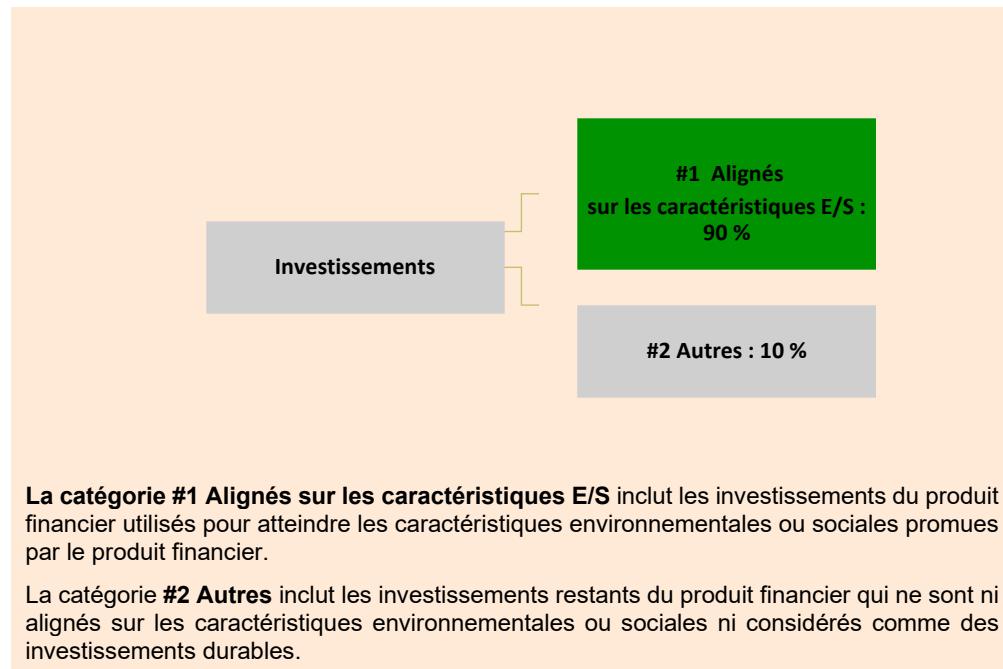
Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

normes ESG mentionnées ci-dessus et dans la méthodologie indicelle (et qui garantissent que le portefeuille soit exempt d'émetteurs dont les activités seraient considérablement préjudiciables à cet objectif).

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.



La catégorie #1 Alignés sur les caractéristiques E/S inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Comment l'utilisation de produits dérivés atteint-elle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?

Le Compartiment n'utilise pas d'instruments financiers dérivés pour promouvoir des caractéristiques environnementales ou sociales dans la mesure où, s'il recourt à ces produits, ce n'est qu'à des fins de couverture de change ou de gestion efficace de portefeuille.



Dans quelle mesure minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Bien que ce Compartiment promeuve des caractéristiques environnementales au sens de l'Article 8 du SFDR, il ne s'est pas pour l'heure actuelle engagé à investir dans des « placements durables » au sens du Règlement taxinomie. En conséquence, le Compartiment ne s'engage pas à investir plus de 0 % de sa Valeur liquidative dans des investissements alignés sur le Règlement relatif à la taxinomie. Il convient dans ce cas de noter que ce Compartiment ne tient pas compte des critères de l'UE pour les activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement sur la taxinomie et que, à ce titre, il ne calcule pas l'alignement du portefeuille sur le Règlement relatif à la taxinomie. Pour cette raison, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce Compartiment.

Le Compartiment ne s'aligne donc pas intentionnellement sur le Règlement relatif à la taxinomie.

Le produit financier investit-il dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

✓ Non

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

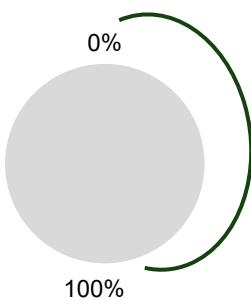
 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

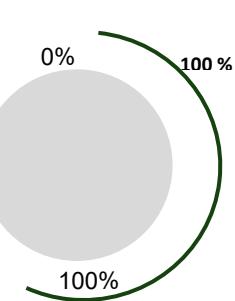
1. Alignement des investissements sur la taxinomie, obligations souveraines incluses*

- Alignés sur la taxinomie (pas de gaz fossile ni de nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie



2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*

- Alignés sur la taxinomie (pas de gaz fossile ni de nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie



Ce graphique représente 100 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle est la part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?

Le Compartiment s'engage à réaliser une part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes.

Quelle est la part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.



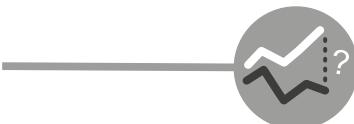
Quelle est la part minimale d'investissements durables ayant un objectif social ?

Non applicable.



Quels sont les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et existe-t-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

Le Compartiment peut détenir une part de ses actifs sous forme de trésorerie ou équivalents de trésorerie et de dérivés utilisés à des fins de couverture de change et de gestion efficace de portefeuille, à la discrétion du Gestionnaire d'investissement, qui seraient classés sous la catégorie « #2 Autres » dans le tableau ci-dessus. Ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'y aura de garanties environnementale ou sociale en place.



Un indice spécifique a-t-il désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut ?

Le Compartiment réplique le plus fidèlement possible la performance de l'indice MSCI Europe Climate Paris Aligned Index (ou de tout autre indice déterminé par les Administrateurs le cas échéant pour répliquer substantiellement le même marché que l'Indice), tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart entre sa performance et celle de l'Indice.

Comment l'indice de référence est-il en permanence aligné sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision constante ainsi qu'un rééquilibrage semestriel au moment desquels l'Univers de l'indice parent est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus.

Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il garanti en permanence ?

Le Compartiment est rééquilibré tous les semestres, conformément à la fréquence de rééquilibrage de l'Indice.

En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?

L'indice désigné applique des exclusions de composantes et des modifications de pondérations, par rapport à l'indice de marché général pertinent, qui sont fonction des caractéristiques ESG des sociétés, sur examen de leur notation ESG ainsi que de leur implication dans certaines activités commerciales controversées, comme appliquées par le fournisseur d'indice, MSCI. Pour toutes informations sur la méthodologie utilisée dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indicelle de MSCI.

Où trouver la méthodologie utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?

https://www.msci.com/eqb/methodology/meth_docs/MSCI_Climate_Paris_Aligned_Indices.pdf

Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?

De plus amples informations sur le produit sont accessibles sur le site internet :

[Investing in SPDR Exchange Traded Funds \(ETFs\) \(ssga.com\)](http://Investing in SPDR Exchange Traded Funds (ETFs) (ssga.com))



SPDR MSCI Europe Climate Paris Aligned UCITS ETF

« MSCI Europe Climate Paris Aligned Index » est une marque de commerce de MSCI et de ses sociétés affiliées, concédée sous licence pour être utilisée à certaines fins par State Street Corporation.

Le Compartiment SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF, basé sur le MSCI Europe Climate Paris Aligned Index, n'a pas été vérifié par MSCI en termes de régularité ou de pertinence, et ne saurait être émis, financé, approuvé, vendu ou promu par MSCI.

LE COMPARTIMENT SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF NE SAURAIT ÊTRE FINANCÉ, APPROUVÉ, VENDU OU PROMU PAR MSCI INC. (« MSCI »), SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, SES FOURNISSEURS D'INFORMATIONS OU TOUTE AUTRE TIERCE PARTIE PARTICIPANT OU LIÉE À LA COMPILEATION, AU CALCUL OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI (COLLECTIVEMENT, LES « PARTIES MSCI »). LES INDICES MSCI SONT LA PROPRIÉTÉ EXCLUSIVE DE MSCI. MSCI ET LES NOMS DES INDICES MSCI SONT UNE OU DES MARQUES DE SERVICE DE MSCI OU DE SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES ET ONT ÉTÉ CONCÉDÉES SOUS LICENCE POUR ÊTRE UTILISÉES À DES FINS SPÉCIFIQUES PAR STATE STREET CORPORATION. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE SAURAIT FAIRE VALOIR OU GARANTIR, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, À L'ÉMETTEUR OU AUX PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF, OU À QUELQUE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS LES COMPARTIMENTS EN GÉNÉRAL OU DANS LE COMPARTIMENT SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF EN PARTICULIER, OU LA CAPACITÉ DE TOUT INDICE MSCI À RÉPLIQUER LA PERFORMANCE DU MARCHÉ BOURSIER CORRESPONDANT. MSCI OU SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES SONT LES CONCÉDANTS DE LICENCE DE CERTAINES MARQUES DE COMMERCE, MARQUES DE SERVICE ET DÉNOMINATIONS COMMERCIALES AINSI QUE DES INDICES MSCI, LESQUELS SONT DÉTERMINÉS, COMPOSÉS ET CALCULÉS PAR MSCI, SANS CONSIDÉRATION DU COMPARTIMENT SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF, DE L'ÉMETTEUR OU DES PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF, OU DE QUELQUE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE SAURAIT ÊTRE TENUE À UNE QUELCONQUE OBLIGATION DE PRISE EN CONSIDÉRATION DES BESOINS DE L'ÉMETTEUR OU DES PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF, OU DE QUELQUE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, POUR DÉTERMINER, COMPOSER OU CALCULER LES INDICES MSCI. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE SAURAIT ÊTRE RESPONSABLE NI AVOIR PARTICIPÉ À LA DÉTERMINATION DU CALENDRIER, DES COURS OU DES QUANTITÉS À ÉMETTRE DU COMPARTIMENT SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF, NI À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION SUR LA BASE DE LAQUELLE OU EN CONSIDÉRATION DE LAQUELLE LE COMPARTIMENT SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF EST RACHETABLE. EN OUTRE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE SAURAIT ÊTRE LIÉE PAR QUELQUE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUE CE SOIT ENVERS L'ÉMETTEUR OU LES PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF, OU QUELQUE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, EU ÉGARD À L'ADMINISTRATION, À LA COMMERCIALISATION OU À L'OFFRE DU COMPARTIMENT SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF.

BIEN QUE LES INFORMATIONS INTÉGRÉES OU UTILISÉES POUR LE CALCUL DES INDICES MSCI SOIENT FOURNIES PAR DES SOURCES JUGÉES FIABLES PAR MSCI, LES PARTIES MSCI NE SAURAIENT CERTIFIER OU GARANTIR L'ORIGINALITÉ, L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DES INDICES MSCI OU DES DONNÉES Y INCLUSES. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE SAURAIT GARANTIR, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, LES RÉSULTATS À OBTENIR PAR

L'ÉMETTEUR DU COMPARTIMENT SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF, LES PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT SPDR MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF OU QUELQUE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, DE L'UTILISATION DES INDICES MSCI OU DES DONNÉES Y INCLUSES. LES PARTIES MSCI NE SAURAIENT ÊTRE TENUES RESPONSABLES EN CAS D'ERREURS, D'OMISSIONS OU D'INTERRUPTIONS EU ÉGARD AUX INDICES MSCI OU AUX DONNÉES INCLUSES DANS CES DERNIERS. EN OUTRE, LES PARTIES MSCI NE SAURAIENT GARANTIR, DE QUELQUE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, ET DÉCLINENT EXPRESSÉMENT PAR LA PRÉSENTE TOUTE GARANTIE DE POTENTIEL COMMERCIAL ET DE PERTINENCE POUR UN USAGE PARTICULIER, EU ÉGARD À CHACUN DES INDICES MSCI ET DES DONNÉES Y INCLUSES. SANS LIMITER LA PORTÉE DE CE QUI PRÉCÈDE, LES PARTIES MSCI NE SAURAIENT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUES RESPONSABLES DE DOMMAGES DIRECTS, INDIRECTS, SPÉCIAUX, PUNITIFS, CONSÉCUTIFS OU AUTRES (Y INCLUS TOUTES PERTES DE PROFITS), QUAND BIEN MÊME ELLES AURAIENT EU CONNAISSANCE DE L'ÉVENTUALITÉ DESDITS DOMMAGES.

À la date du Supplément, le Compartiment utilise (au sens du Règlement sur les indices de référence) l'indice de référence MSCI Limited suivant :

MSCI Europe Climate Paris Aligned Index.

À la date du Supplément, aucune entité de MSCI Limited n'est inscrite dans le registre AEMF visé à l'Article 36 du Règlement sur les indices de référence. MSCI Limited est et demeure autorisé en tant qu'administrateur d'indices de référence britannique réglementé par la Financial Conduct Authority au Royaume-Uni (« FCA ») (et figure au registre des services financiers de la FCA). Cependant, elle sera considérée comme un administrateur britannique d'un « pays tiers » vis-à-vis de l'UE et ne figurera pas au Registre d'indices de l'AEMF, visé à l'article 36 du Règlement sur les indices de référence, à moins que l'UE n'accorde l'« équivalence » pour le Royaume-Uni ou que MSCI se voit accorder l'« aval » ou la « reconnaissance ».

« SPDR® » est une marque de commerce déposée de Standard & Poor's Financial Services LLC (« S&P »), concédée sous licence d'utilisation à State Street Corporation. Aucun des produits financiers offerts par State Street Corporation ou ses sociétés affiliées n'est financé, approuvé, vendu ou promu par S&P ou ses sociétés affiliées, et S&P et ses sociétés affiliées ne sauraient faire valoir, garantir ou conditionner une quelconque opportunité d'acheter, de vendre ou de détenir des actions/parts dans ces produits. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR® et S&P 500® sont des marques de commerce déposées de Standard & Poor's Financial Services LLC et font l'objet d'une licence d'utilisation concédée à State Street Corporation.