

# SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF

## *Supplément N° 65*

(Un compartiment de SSGA SPDR ETFs Europe I 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 22 décembre 2023 et amendé le cas échéant (le « Prospectus »). Ce Supplément doit être lu conjointement au Prospectus et au Document d'informations clés relatifs aux produits d'investissement packagés de détail et fondés sur l'assurance (« DIC relatif aux PRIIP ») ou au Document d'information clé pour l'investisseur (« DICI »). Il présente les informations relatives au Compartiment SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF (le « Compartiment »), représenté dans la Société par les séries d'actions SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG 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	Pour les catégories d'actions de distribution, distribution semestrielle du revenu (aux environs des mois de janvier et juillet), sauf lorsque la Société de gestion décide, à son entière discrétion, de ne pas verser de dividende à une date de distribution donnée. Pour les catégories d'actions de capitalisation, l'ensemble des revenus et plus-values sera cumulé dans la Valeur liquidative par Action. Statut de distribution ou de capitalisation indiqué à la page suivante parmi les renseignements sur la catégorie d'actions.
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	Pour les souscriptions et rachats en numéraire de catégories d'actions non couvertes : 14 h (heure irlandaise), chaque Jour de négociation. Pour les souscriptions et rachats en nature de catégories d'actions non couvertes : 16 h (heure irlandaise), chaque Jour de négociation. Pour les souscriptions et rachats en numéraire et en nature de catégories d'actions couvertes : 14 h (heure irlandaise), chaque Jour de négociation. Pour l'ensemble des souscriptions et des rachats effectués le dernier Jour de négociation précédant le 25 décembre et le 1 <sup>er</sup> janvier de chaque année : 11 h (heure irlandaise). La Société de gestion pourra déterminer des dates antérieures ou ultérieures à sa discrétion, à condition d'avoir notifié les Participants agréés au préalable.
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)	Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select Index (I36753EU).
Fréquence de rééquilibrage de l'Indice	Mensuelle.
Informations complémentaires sur l'Indice	Les détails complémentaires relatifs à l'Indice et à sa performance sont consultables sur <a href="https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/">https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/</a>

### Informations sur la valorisation

Valorisation	La Valeur liquidative par Action est calculée conformément aux dispositions stipulées sous la section « <b>Détermination de la Valeur liquidative</b> » du Prospectus.
Cours de valorisation utilisés	Cours acheteurs de clôture.
Point de valorisation	16 h 15 (heure irlandaise), chaque Jour ouvrable.

**SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF**

**Catégories d'actions**

Type de Catégorie d'actions	Non couverte en EUR		Couverte en GBP		Couverte en CHF		Couverte en USD	
<b>Nom</b>	SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF		SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG GBP Hdg UCITS ETF		SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG CHF Hdg UCITS ETF		SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG USD Hdg UCITS ETF	
<b>Politique en matière de dividendes*</b>	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc
<b>Devise associée à la Catégorie d'actions</b>	EUR		GBP		CHF		USD	
<b>Indice couvert contre le risque de change</b>	s/o		Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select Index (couvert en GBP)		Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select Index (couvert en CHF)		Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select Index (couvert en USD)	
<b>Ticker de l'indice</b>	I36753EU		H36753GB		H36753CH		H36753US	
<b>TFE</b> (pour toute information complémentaire, veuillez vous reporter à la section « <b>Commissions et frais</b> » du Prospectus)	Jusqu'à 0,12 %		Jusqu'à 0,17 %		Jusqu'à 0,17 %		Jusqu'à 0,17 %	

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

## Objectif et politique d'investissement

**Objectif d'investissement :** L'objectif du Compartiment est de fournir aux investisseurs un rendement total, en tenant compte à la fois des rendements de capital et des revenus, qui reflète généralement le rendement de l'indice Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select Index.

**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 discrétion 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 est un indice de référence représentant des titres de qualité *investment grade* à taux fixe et libellés en euros visant à optimiser le score R-Factor™, une notation reflétant le respect des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance (« **ESG** ») fournie par Street Global Advisors®. Basé sur l'indice Bloomberg Euro Corporate 0-3 Year Index (l'« **Euro Corporate 0-3 Index** »), l'Indice sélectionne des titres éligibles à l'Euro Corporate 0-3 Index, puis vise à exclure certains émetteurs en fonction de leurs caractéristiques ESG, compte tenu de leur score ESG et de leur implication dans certaines activités controversées, comme indiqué dans la méthodologie de l'Indice. Les titres sont ensuite pondérés au sein de l'Indice par le biais d'un processus d'optimisation, afin de chercher à maximiser la notation ESG du portefeuille tout en contrôlant le risque actif total. Le risque actif total fait référence à la variation entre l'Indice et l'indice Euro Corporate 0-3 Index.

Le Compartiment investit au moins 90 % de ses actifs dans des titres composant l'Indice tandis que le Fournisseur d'indice applique des notations ESG à toutes les composantes de ce dernier. Il est prévu que la notation ESG du portefeuille qui en résultera sera supérieure à la notation ESG du portefeuille de l'indice Euro Corporate 0-3 Index après application d'un filtre éliminant au moins 20 % des titres les moins bien notés, en termes de notation ESG, de l'indice en question.

L'adoption de ce processus de filtrage et des critères « best in class » au sein de l'Indice correspond aux facteurs environnementaux et sociaux que le Compartiment promeut, comme décrit plus en détail dans les sous-sections « **Filtrage ESG** » et « **Investissement ESG Best in Class** » de la section « **Investissement ESG** » du Prospectus. Les entreprises que le fournisseur de l'Indice estime ne pas violer les Principes du Pacte mondial des Nations Unies sont considérées comme faisant 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.

L'Indice mesure la performance du marché des obligations d'entreprise à échéance courte en euro. Seules les obligations assorties d'une échéance inférieure à trois ans sont incluses, et toutes les obligations comprises dans l'Indice seront bloquées jusqu'à échéance. L'insertion dépend de la devise d'émission, et non de la domiciliation de l'émetteur. 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.

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 d'échantillonnage stratifié, comme indiqué plus en détail sous la section « **Objectifs et politiques d'investissement – Fonds indicatifs** » du Prospectus, essentiellement dans les 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 peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice mais dont il juge qu'ils reflètent fidèlement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Dans ce cas, l'attribution d'une notation ESG à ces titres sélectionnés ne saurait être garantie. Les titres obligataires dans lesquels le Compartiment investit seront principalement cotés ou négociés sur des Marchés reconnus conformément aux restrictions prévues par 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

**Obligations :** Les titres dans lesquels le Compartiment investit peuvent inclure les obligations d'État et obligations rattachées ainsi que les obligations d'entreprise.

**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, aux contrats de change à terme (y compris aux contrats de change à terme non livrables). 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 revente 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 de concentration :** Lorsque le Compartiment concentre ses investissements dans une devise donnée, l'activité financière, économique et autres évolutions qui affectent les émetteurs dans ladite devise auront une incidence plus importante sur le Compartiment que s'il avait été plus diversifié. Cette concentration peut également limiter la liquidité du Compartiment. Les investisseurs peuvent acheter ou vendre des montants substantiels d'actions du Compartiment en réponse aux facteurs qui affectent ou sont susceptibles d'affecter une devise dans laquelle le Compartiment concentre ses investissements.

**Titres de créance – Risque de crédit :** La valeur d'un titre de créance peut être défavorablement affectée par la capacité de l'émetteur, réelle ou perçue, à procéder aux paiements en temps opportun. La capacité d'un émetteur à satisfaire à ses obligations concernant les titres détenus par le Compartiment peut se réduire substantiellement. La note allouée à un investissement particulier ne reflète pas nécessairement la situation financière actuelle de l'émetteur ni une évaluation de la volatilité ou de la liquidité d'un investissement. Les titres de qualité *investment grade* peuvent toujours connaître des difficultés de crédit conduisant à la perte de tout ou partie des sommes investies. Si un titre détenu par un Compartiment perd sa note ou voit sa note dégradée, le Compartiment peut néanmoins continuer de détenir le titre en question à la discrétion du Gestionnaire d'investissement et/ou du Gestionnaire d'investissement par délégation.

**Risque associé aux produits et instruments dérivés :** Le Compartiment peut utiliser des IFD à des fins de couverture de change et de gestion efficace de portefeuille, comme stipulé au paragraphe « Instruments 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 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.

**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<sup>er</sup> 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.

## 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 du marché des obligations d'entreprise de qualité *investment grade* à échéance courte et libellées en euros, et qui sont prêts à accepter les risques associés aux investissements de ce type ainsi que la volatilité prévisionnelle faible à moyenne de ce 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 de liquidités ou de titres en nature libérés. 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 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 seront disponibles à partir de 9 h (heure irlandaise) le 27 décembre 2023 jusqu'à 15 h (heure irlandaise) le 26 juin 2024, ou toute autre date antérieure ou postérieure déterminée à la discrétion des Administrateurs qui en notifieront la Banque centrale (la « **Période d'offre initiale** »). Le prix d'offre initial sera d'environ 30 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 relative au Règlement 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 Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Identifiant d'entité juridique :** 549300ZOZNY8CER0YP19

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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

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

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

Le Compartiment promeut les facteurs environnementaux et sociaux qui participent aux scores R-Factor™ appliqués aux composantes de l'indice, en ce compris l'indice Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select Index (l'« Indice »), lesquels sont fonction de l'évaluation et de la notation établies par le fournisseur de l'Indice sur diverses caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance pour les entreprises comprises dans l'univers de l'Indice.

Pour plus d'informations sur les scores R-Factor™, veuillez vous reporter au site Internet de SSGA : [https://www.ssga.com/uk/en\\_gb/intermediary/ic/capabilities/esg/data-scoring/r-factor-transparent-esg-scoring#:~:text=R%2DFactor%E2%84%A2%20is%20the%20materiality%20in%20the%20scoring%20process](https://www.ssga.com/uk/en_gb/intermediary/ic/capabilities/esg/data-scoring/r-factor-transparent-esg-scoring#:~:text=R%2DFactor%E2%84%A2%20is%20the%20materiality%20in%20the%20scoring%20process).

En outre, l'Indice exclut les émetteurs qui sont associés aux controverses sur des événements extrêmes, aux armes controversées, aux violations des principes du Pacte mondial des Nations unies (« PMNU »), aux armes à feu civiles, à l'extraction de charbon thermique et à la production d'électricité à partir de charbon thermique, à l'exploitation des sables bitumineux, à l'exploration pétrolière et gazière en arctique et à l'industrie du tabac.



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 ?**

Les indicateurs de durabilité, utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce Compartiment, sont basés sur l'Indice, lequel optimise une notation ESG formée/constituée par un « facteur de responsabilité » (« R-Factor™ »). Le R-Factor aborde la cotation ESG en exploitant le spectre intégral des éléments de mesure « financièrement significatifs » pour isoler les facteurs de durabilité à long terme d'importance dans l'ensemble des dimensions que sont l'environnement, le capital humain, le capital social, le modèle économique, le leadership et la gouvernance d'entreprise.

La méthodologie d'attribution des scores intègre systématiquement les meilleures données (« best-in-class »), un cadre de durabilité transparent, l'importance relative des différents secteurs d'activité sur le plan financier et des normes de gouvernance d'entreprise et ce, afin de définir un score R-Factor pour chaque entreprise.

**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

*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 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 la performance de ce dernier et celle de l'Indice.

L'Indice est un indice de référence à taux fixe, libellé en euros et de qualité *investment grade* (qualité élevée), qui optimise son score R-Factor™, une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »), fournie par State Street Global Advisors®. Basé sur l'indice Bloomberg Euro Corporate 0-3 Year Index (l'« Euro Corporate 0-3 Index »), l'Indice sélectionne des titres éligibles à l'Euro Corporate 0-3 Index, puis vise à exclure certains émetteurs en fonction de leurs caractéristiques ESG, compte tenu de leur score ESG et de leur implication dans certaines activités controversées, comme indiqué dans la méthodologie de l'Indice.

Les titres sont ensuite pondérés au sein de l'Indice par le biais d'un processus d'optimisation, afin de chercher à maximiser la notation ESG du portefeuille tout en contrôlant le risque actif total. Le risque actif total fait référence à la variation entre l'Indice et l'indice Euro Corporate 0-3 Index.

Le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation investissent pour le compte du Compartiment, selon la stratégie d'échantillonnage stratifié décrite plus en détail sous la section « Objectifs et politiques d'investissement – Fonds indicieux » 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.

Le Compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales via l'utilisation de filtres qui visent à exclure les titres liés à certains secteurs, certaines entreprises ou pratiques, sur la base de critères ESG spécifiques, et l'adoption d'une approche « best-in-class » sur la base de la performance ESG en comparaison des univers d'investissement et/ou des homologues du secteur lorsqu'ils sont évalués selon des critères objectifs au sein de l'Indice.

### 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 indicieuse de l'indice Bloomberg qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

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.

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

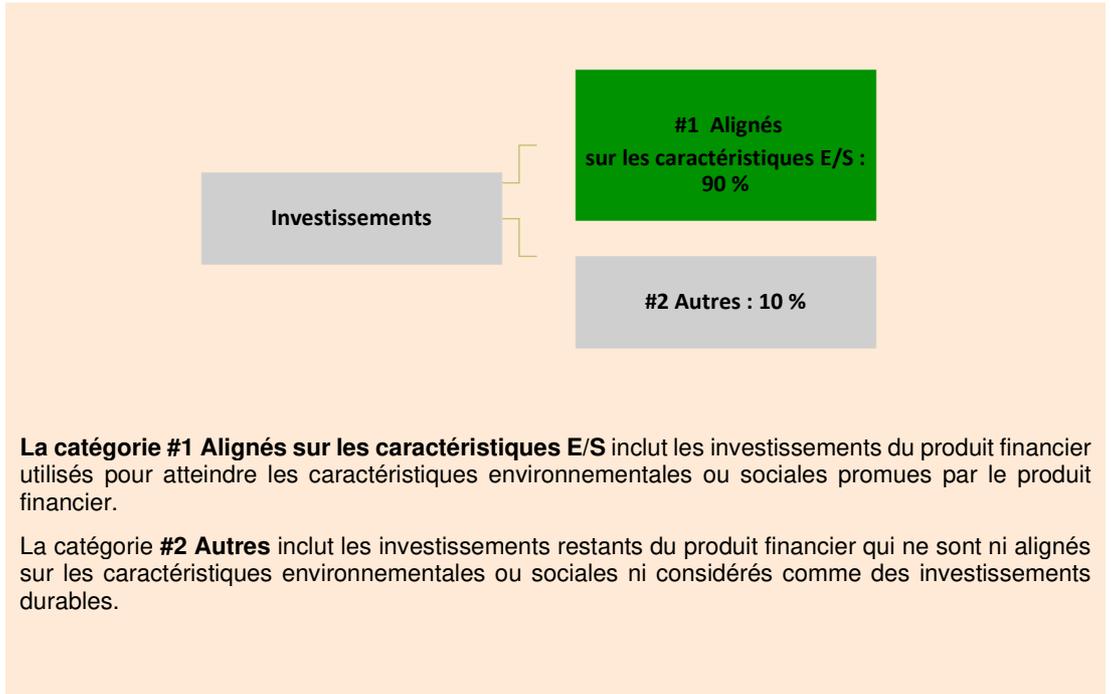
Le Compartiment investit au moins 90 % de ses actifs dans des titres qui composent l'Indice et sont alignés sur des caractéristiques environnementales et/ou sociales, tandis que le Fournisseur d'indice applique des notations ESG à toutes les composantes de l'Indice. Le Compartiment ne s'engage pas à 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 discrétion 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.

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.

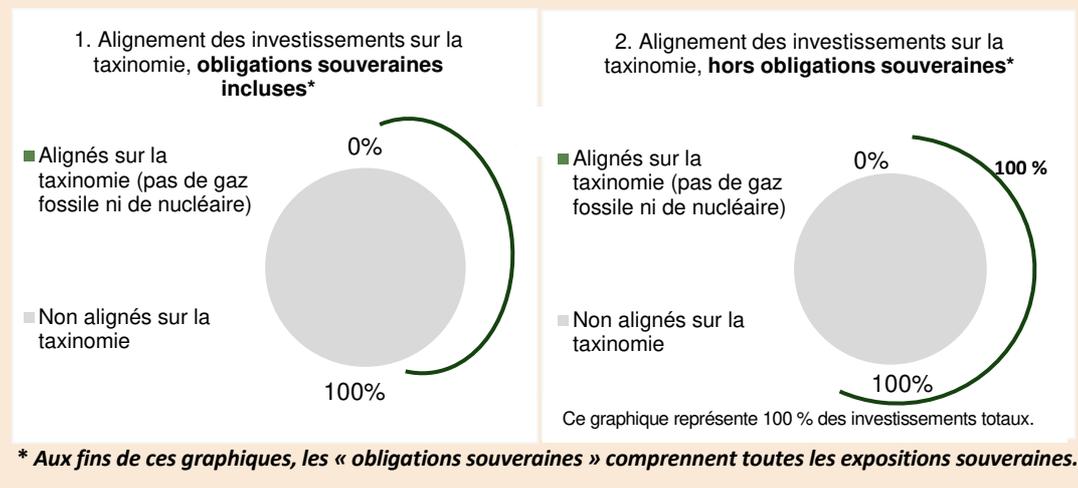
**Le produit financier investit-il dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>1</sup> ?**

- Oui :**
- Dans le gaz fossile  Dans l'énergie nucléaire
- Non**

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.

**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.**



**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**

Le symbole  représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux

<sup>1</sup> 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.

activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



### **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 promet ?**

Le Compartiment réplique le plus fidèlement possible la performance de l'indice Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select 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. L'Indice est un indice de référence à taux fixe, libellé en euros et de qualité *investment grade* qui optimise son score R-Factor™, une notation ESG, fournie par State Street Global Advisors® et décrite ci-dessus.

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

#### ***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 et un rééquilibrage mensuels.

#### ***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 mois, 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, à savoir Bloomberg. 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 indiciaire de Bloomberg.

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

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

#### **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 \(ETFs\) \(ssga.com\)](https://www.ssga.com)



BLOOMBERG® et Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select Index sont des marques de service de Bloomberg Finance L.P. et ses affiliées, en ce compris Bloomberg Index Services Limited (« BISL »), l'administrateur de l'indice (collectivement « Bloomberg »), et ont été concédées sous licence pour être utilisées à certaines fins par State Street.

Le Compartiment SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF ne saurait être financé, approuvé, vendu ou promu par Bloomberg. Bloomberg ne saurait faire valoir ou garantir, de manière expresse ou implicite, aux propriétaires ou aux contreparties du Compartiment SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF ou à tout autre membre du public, l'opportunité d'investir dans des titres en général ou dans le Compartiment SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF en particulier. La seule relation de Bloomberg et State Street se limite à la concession sous licence de certaines marques de commerce, dénominations commerciales et marques de service de l'indice Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select Index, lequel est déterminé, composé et calculé par BISL, sans considération de State Street ou du Compartiment SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF. Bloomberg ne saurait être tenue de prendre en considération les besoins de State Street ou des propriétaires du Compartiment SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF dans la détermination, la composition ou le calcul de l'indice Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select Index. Bloomberg ne saurait être responsable ni avoir participé à la détermination du calendrier, des prix ou des quantités du Compartiment SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF à émettre. Bloomberg ne saurait être tenue de quelque obligation ou responsabilité que ce soit, y compris, sans limitation, envers les clients du Compartiment SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF, relativement à l'administration, la commercialisation ou la négociation du Compartiment SPDR Bloomberg SASB 0-3 Year Euro Corporate ESG UCITS ETF.

BLOOMBERG NE SAURAIT GARANTIR L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE L'INDICE BLOOMBERG SASB EURO CORPORATE 0-3 YEAR ESG EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX OU DES DONNÉES Y AFFÉRENTES ET NE SAURAIT ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'AUCUNE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION EN CONSÉQUENCE. BLOOMBERG NE SAURAIT GARANTIR, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, LES RÉSULTATS À OBTENIR PAR STATE STREET, LES PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT SPDR BLOOMBERG SASB 0-3 YEAR EURO CORPORATE ESG UCITS ETF OU QUELQUE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, DE L'UTILISATION DE L'INDICE BLOOMBERG SASB EURO CORPORATE 0-3 YEAR ESG EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX OU DES DONNÉES Y AFFÉRENTES. BLOOMBERG NE SAURAIT GARANTIR, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTES GARANTIES DE POTENTIEL COMMERCIAL OU D'EFFICACITÉ À DES FINS SPÉCIFIQUES OU POUR UN USAGE PARTICULIER RELATIVEMENT À L'INDICE BLOOMBERG SASB EURO CORPORATE 0-3 YEAR ESG EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX OU AUX DONNÉES Y AFFÉRENTES. SANS PRÉJUDICE DES DISPOSITIONS QUI PRÉCÈDENT, DANS TOUTE LA MESURE LÉGALEMENT

AUTORISÉE, BLOOMBERG, SES DONNEURS DE LICENCE ET LEURS EMPLOYÉS, SOUS-TRAITANTS, MANDATAIRES, FOURNISSEURS ET VENDEURS RESPECTIFS NE SAURAIENT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUS RESPONSABLES DE QUELQUES PRÉJUDICES OU DOMMAGES QUE CE SOIT – DIRECTS, INDIRECTS, CONSÉCUTIFS, FORTUITS, PUNITIFS OU AUTRES – LIÉS AU COMPARTIMENT SPDR BLOOMBERG SASB 0-3 YEAR EURO CORPORATE ESG UCITS ETF OU À L'INDICE BLOOMBERG SASB EURO CORPORATE 0-3 YEAR ESG EX-CONTROVERSIES SELECT INDEX OU À TOUTES DONNÉES OU VALEURS Y RATTACHÉES, QU'ILS RÉSULTENT DE LEUR NÉGLIGENCE OU AUTREMENT, QUAND BIEN MÊME ILS AURAIENT ÉTÉ INFORMÉS DE LA POSSIBILITÉ Y RATTACHÉE.

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

Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select Index

À la date du présent Supplément, BISL, administrateur au Royaume-Uni, n'est plus inscrit dans le registre AEMF visé à l'article 36 du Règlement sur les indices de référence. La période de transition pour les indices de référence d'un pays tiers en vertu du Règlement sur les indices de référence s'étend, néanmoins, jusqu'au 31 décembre 2025. Les entités surveillées par l'UE pourront continuer à utiliser des indices de référence de pays tiers comme l'indice Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select Index pendant cette période.

SASB® ne se prononce aucunement sur la question de savoir si un émetteur doit être ou non inclus dans l'indice Bloomberg SASB Euro Corporate 0-3 year ESG Ex-Controversies Select.

« 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.