

SPDR MSCI Resilient Future UCITS ETF

Supplément N° 59

(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 contient les informations relatives au SPDR MSCI Resilient Future UCITS ETF (le « Compartiment »), représenté par la série d'actions SPDR MSCI Resilient Future UCITS ETF émises par la société (les « Actions »).

Dans la mesure où le Compartiment est largement exposé aux marchés émergents, un investissement dans le Compartiment ne doit pas constituer une part importante d'un portefeuille d'investissement et peut ne pas être adapté à tous les investisseurs.

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	USD.
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 mai et novembre), 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. Le statut de distribution ou de capitalisation est indiqué 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	Souscriptions et rachats en numéraire : 16 h (heure irlandaise), chaque Jour de négociation. Souscriptions et rachats en espèces effectués le dernier Jour de négociation précédant le 25 décembre et le 1 ^{er} 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. Les Actionnaires ne sont pas autorisés à effectuer des règlements en nature.
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 le Jour ouvrable suivant le 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 ACWI IMI Resilient Future Select 35/20 Capped Index (NU758475)
Fréquence de rééquilibrage de l'Indice	Semestrielle.
Informations complémentaires sur l'Indice	Les détails complémentaires relatifs à l'Indice et à sa performance sont consultables sur : https://www.msci.com/documents/10199/c2aec426-e005-1eb1-0d8e-744284b1a79a https://www.msci.com/constituents

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	22 h 15 (heure irlandaise), chaque Jour ouvrable.

Catégories d'actions

Type de Catégorie d'actions	Non couverte en USD	
Nom	SPDR MSCI Resilient Future UCITS ETF	
Politique en matière de dividendes*	Acc	Dist
Devise associée à la Catégorie d'actions	USD	
Ticker de l'indice	NU758475	
TFE (pour toute information complémentaire, veuillez vous reporter à la section « Commissions et frais » du Prospectus)	Jusqu'à 0,30 %	

* 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 marchés actions des pays développés et émergents.

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 mesure la performance des sociétés d'envergure mondiale associées au développement de produits et services axés sur les composantes liées à la thématique d'un avenir résilient (« Resilient Future ») qui sont susceptibles de jouer un rôle important pour assurer la transition vers une économie mondiale plus durable, en réduisant la probabilité de franchir des points de bascule écologiques irréversibles tels qu'un changement climatique significatif, le tarissement des nappes phréatiques ou la perte de biodiversité. D'après l'évaluation du Fournisseur d'indice, les activités commerciales liées au thème « Resilient Future » comprennent les solutions pour l'énergie propre, l'alimentation et l'agriculture alternatives, les solutions de gestion de l'eau, ainsi que la prévention et le contrôle de la pollution. Les bénéficiaires d'investissement admissibles dans le Compartiment peuvent être des sociétés de grande, moyenne ou petite capitalisation, des marchés développés comme des marchés émergents. Les titres sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant.

L'Indice exclut certaines sociétés en raison de leur implication dans les **activités commerciales controversées** suivantes : armes controversées, armes à feu civiles, tabac, extraction de charbon thermique, énergie thermique au charbon (excepté si 50 % ou plus de leur revenu global sont tirés des énergies alternatives, de la production d'énergie hydraulique, de la gestion durable de l'eau et de la protection du capital naturel), extraction de pétrole et de gaz non conventionnels, extraction de pétrole et de gaz en Arctique et huile de palme, pétrole et gaz, production d'énergie à base de combustibles fossiles. Les détails complémentaires concernant la définition de ce qui constitue une « implication » sont précisés par le Fournisseur d'indice dans la méthodologie indiciaire.

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 environnementale, sociale 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** »). Enfin, l'Indice exclut également les sociétés jugées « Nettement désalignées » en termes d'Alignement net sur l'un des Objectifs de développement durable des Nations unies (« **ODD de l'ONU** ») sélectionnés, à savoir l'ODD 6 (visé à garantir l'accès de tous à des services d'alimentation en eau et d'assainissement gérés de façon durable), l'ODD 7 (visé à garantir l'accès de tous à des services énergétiques fiables, durables et modernes, à un coût abordable), l'ODD 9 (visé à bâtir une infrastructure résiliente, promouvoir une industrialisation durable qui profite à tous et encourager l'innovation), l'ODD 12 (visé à établir des modes de consommation et de production durables), l'ODD 13 (visé à prendre d'urgence des mesures pour lutter contre les changements climatiques et leurs répercussions), l'ODD 14 (visé à conserver et exploiter de manière durable les océans, les mers et les ressources marines aux fins du développement durable), et l'ODD 15 (visé à préserver et restaurer les écosystèmes terrestres, en veillant à les exploiter de façon durable, gérer durablement les forêts, lutter contre la désertification, enrayer et inverser le processus de dégradation des terres et mettre fin à l'appauvrissement de la biodiversité). Le Score minimum de controverse ESG de MSCI et le Score minimum de controverse environnementale de MSCI, établis par le Fournisseur d'indice pour déterminer l'admissibilité à l'inclusion dans l'Indice, peuvent être consultés sur le site Internet du Fournisseur d'indice <https://www.msci.com/index-methodology>.

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment incluent : i) la réduction de l'utilisation de ressources naturelles non renouvelables et de la pollution ; ii) la réduction de sévères controverses liées à l'environnement ; et iii) l'engagement pour les droits de l'homme et l'impact sur la société ainsi que pour le droit du travail, la chaîne d'approvisionnement et les émetteurs centrés sur la satisfaction du client qui privilégient la qualité des produits et le bien-être du consommateur. La définition de « l'engagement » pour chaque activité peut être fondée sur le fait de générer ou de tirer de l'activité un revenu supérieur à un pourcentage de revenu ou à un seuil de revenu total défini, ou sur toute exposition à l'activité, indépendamment du niveau de revenu perçu, conformément à la méthodologie de l'Indice. Veuillez vous référer à l'Annexe SFDR du présent Supplément pour plus de détails.

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. Après filtrage de

l'univers de l'Indice standard, l'univers de l'Indice est réduit d'au moins 20 %.

Le portefeuille du Compartiment est principalement composé de titres conformes aux normes ESG mentionnées ci-dessus et dans la méthodologie indicielle (qui garantissent que le portefeuille soit exempt de titres 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 en composants individuels de l'Indice émis par le même organisme à hauteur de 20 % maximum de la Valeur liquidative du Compartiment, et une position plafonnée à 35 % de la Valeur liquidative du Compartiment en composants de l'Indice émis par le même organisme en raison de conditions de marché exceptionnelles (à savoir, quand l'émetteur représente une proportion importante inhabituelle de ce marché si on mesure cette proportion d'après l'Indice).

Le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation investiront pour le compte du Compartiment, selon la stratégie de réplification décrite plus en détail sous la section « Objectifs et politiques d'investissement – Fonds indiciaires » 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 jointe au présent Supplément.

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 concentration : Quand un Compartiment concentre ses investissements sur un marché donné, l'activité financière, économique et autres évolutions qui affectent les émetteurs sur ledit marché 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 à des facteurs qui affectent ou sont susceptibles d'affecter un marché sur lequel le Compartiment concentre ses investissements.

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 lié aux entreprises de petite taille : Les titres des entreprises de petite, moyenne, et micro capitalisation peuvent être plus volatils et négociés moins fréquemment et dans des volumes plus limités que les titres des plus grandes entreprises. Ces entreprises peuvent avoir des familles de produits, des marchés ou des ressources

financières limités, ne pas disposer de la capacité concurrentielle des plus grandes entreprises, et être dépendantes d'un personnel clé limité. De plus, ces entreprises peuvent avoir des antécédents de performances limités ou inexistantes.

Risque lié aux marchés émergents : Les risques d'investissement dans les marchés émergents incluent, entre autres, une instabilité politique et économique plus importante, de possibles barrières commerciales, un niveau moindre de supervision et de réglementation gouvernementales, une volatilité plus forte des taux de change, des restrictions de transfert des devises ou des difficultés à construire une exposition de change, un niveau moindre de développement des marchés de titres, des systèmes juridiques et des industries de services financiers, des différences en termes de normes d'audit et d'information financière, et une plus forte dépendance aux revenus de matières premières particulières ou à l'aide internationale.

Risque d'investissement en RPC : Outre les risques liés aux investissements sur les marchés émergents, les risques liés aux investissements sur les marchés en RPC incluent, entre autres, ceux de suspension à la négociation, de restriction en matière de transfert de/exposition aux devises, d'annulation ou de modification des instructions, de limitation en termes de détention d'investissements en RPC et d'usage de courtiers. Ils incluent également ceux liés aux concepts non testés concernant le nouveau traitement de la propriété effective, à la fiabilité du ou des Programmes d'accès qui peuvent être interrompus ou considérablement modifiés, au système technologique et aux contrôles associés à ces Programmes d'accès, à la conservation d'actifs, en ce compris l'insuffisance de ségrégation des actifs parmi ceux de l'entité QFI, des autres intermédiaires en vertu des Programmes d'accès concernés et des Dépositaires par délégation concernés et enfin, ceux liés à l'incertitude entourant la fiscalité.

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 « 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 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.

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 marchés d'actions des pays développés et émergents et qui sont prêts à accepter les risques associés aux investissements de ce type, dont 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.

SPDR MSCI Resilient Future UCITS ETF

« MSCI ACWI IMI Resilient Future Select 35/20 Capped 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 RESILIENT FUTURE UCITS ETF, basé sur le MSCI ACWI IMI Resilient Future Select 35/20 Capped 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 RESILIENT FUTURE UCITS ETF NE SAURAIT ÊTRE FINANÇÉ, 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 COMPILATION, 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. LES PARTIES MSCI NE SAURAIENT FAIRE VALOIR OU GARANTIR, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, À L'ÉMETTEUR OU AUX PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT SPDR MSCI RESILIENT FUTURE UCITS ETF, OU À QUELQUE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS LES COMPARTIMENTS EN GÉNÉRAL OU DANS LE COMPARTIMENT SPDR MSCI RESILIENT FUTURE UCITS ETF EN PARTICULIER, OU LA CAPACITÉ DE TOUT INDICE MSCI À RÉPLIQUER LA PERFORMANCE DU MARCHÉ BOURSIER CORRESPONDANT. MSCI OU SES AFFILIÉES SONT LES DONNEURS 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 RESILIENT FUTURE UCITS ETF, DE L'ÉMETTEUR OU DES PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT SPDR MSCI RESILIENT FUTURE UCITS ETF, OU DE QUELQUE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ. LES PARTIES MSCI NE SAURAIENT ÊTRE TENUES D'AUCUNE OBLIGATION DE PRISE EN CONSIDÉRATION DES BESOINS DE L'ÉMETTEUR OU DES PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT SPDR MSCI RESILIENT FUTURE UCITS ETF, OU DE QUELQUE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, POUR DÉTERMINER, COMPOSER OU CALCULER LES INDICES MSCI. LES PARTIES MSCI NE SAURAIENT ÊTRE RESPONSABLES DE, NI AVOIR PARTICIPÉ À LA DÉTERMINATION DU CALENDRIER, DES COURS OU DES QUANTITÉS À ÉMETTRE DU COMPARTIMENT SPDR MSCI RESILIENT FUTURE UCITS ETF OU À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION SUR LA BASE DE LAQUELLE OU EN CONSIDÉRATION DE LAQUELLE LE COMPARTIMENT SPDR MSCI RESILIENT FUTURE UCITS ETF EST RACHETABLE. EN OUTRE, LES PARTIES MSCI NE SAURAIENT ÊTRE LIÉES PAR QUELQUE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUE CE SOIT ENVERS L'ÉMETTEUR OU LES PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT SPDR MSCI RESILIENT FUTURE UCITS ETF, OU QUELQUE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, EU ÉGARD À L'ADMINISTRATION, À LA COMMERCIALISATION OU À L'OFFRE DU COMPARTIMENT SPDR MSCI RESILIENT FUTURE 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. LES PARTIES MSCI NE SAURAIENT GARANTIR, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, LES RÉSULTATS À OBTENIR PAR L'ÉMETTEUR DU COMPARTIMENT SPDR MSCI RESILIENT FUTURE UCITS ETF, LES PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT SPDR MSCI RESILIENT FUTURE UCITS ETF OU TOUTE 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 ACWI IMI Resilient Future Select 35/20 Capped 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 une décision d'« 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.

©2023 State Street Corporation. Tous droits réservés.

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 Resilient Future UCITS ETF (le « Compartiment »)

Identifiant d’entité juridique : 9845002D75F2C8851626

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

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

☒ ☒ ☐ Oui

☒ ☐ ☒ Non

☐ Il réalisera un minimum d’investissements durables ayant un objectif environnemental : ____ %

☒ 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 30 % d’investissements durables

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l’UE

☐ 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

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l’UE

☒ 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

☒ ayant un objectif social

☐ Il réalisera un minimum d’investissements durables ayant un objectif social : ____ %

☐ Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d’investissements durables

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

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales associées à la réduction de l’utilisation de ressources naturelles non renouvelables et de la pollution en excluant des émetteurs dont les revenus sont fortement exposés, par exemple, à l’extraction de charbon thermique, à l’énergie thermique au charbon, à l’extraction de pétrole et de gaz non conventionnels, à l’extraction de pétrole et de gaz en Arctique, à l’huile de palme, et au pétrole et au gaz, conformément à l’indice MSCI ACWI IMI Resilient Future Select 35/20 Capped Index (l’« Indice »).

Le Compartiment promeut également des caractéristiques environnementales associées à la réduction de sévères controverses liées à l’environnement, en excluant des émetteurs classés sous « Drapeau rouge » ou « Drapeau orange » concernant les controverses environnementales (à l’aide du Score de controverse environnementale MSCI, comme indiqué plus en détail ci-dessous), ce qui peut inclure la biodiversité et l’utilisation des sols, l’énergie et le changement climatique, la gestion de la chaîne d’approvisionnement, le stress hydrique, les émissions et les déchets toxiques, les déchets d’exploitation (non dangereux) et d’autres controverses. Une note de controverse mesure l’implication (ou l’implication supposée) d’un émetteur dans des incidents ayant des répercussions environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) négatives.

En outre, le Compartiment promeut des caractéristiques sociales associées à l’engagement des émetteurs pour :

(i) les droits de l’homme et l’impact sur la société ;

(ii) le droit du travail et la chaîne d’approvisionnement ; et

(iii) les émetteurs centrés sur la satisfaction du client qui privilégient la qualité des produits et

le bien-être du consommateur.

La définition de « l'engagement » pour chaque activité peut être fondée sur le fait de générer ou de tirer de l'activité un revenu supérieur à un pourcentage de revenu ou à un seuil de revenu total défini, ou sur toute exposition à l'activité, indépendamment du niveau de revenu perçu. L'activité peut porter sur la production ou la distribution, ou les deux, conformément à la méthodologie de l'Indice. Des informations complémentaires sur les exclusions appliquées afin de promouvoir les caractéristiques environnementales et/ou sociales figurent dans la méthodologie de l'Indice.

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales en suivant l'Indice. La méthodologie de l'Indice correspond aux caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.

Pour obtenir plus d'informations sur les notations ESG de MSCI et sur l'évaluation des controverses ESG de MSCI, veuillez consulter les liens suivants :

<https://www.msci.com/esg-and-climate-methodologies>

<https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/ESG-Research-Controversies-Methodology.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4?t=1692378693072>

Pour obtenir des informations complémentaires sur la méthodologie de l'Indice, veuillez vous référer à la section « Où trouver la méthodologie utilisée pour le calcul de l'indice désigné ? » (ci-dessous)



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 suivants font partie intégrante des critères ESG de l'Indice que le Compartiment réplique et, par conséquent, la réalisation des caractéristiques environnementales et/ou sociales associées est mesurée via l'exclusion par l'Indice des sociétés qui sont impliquées dans des activités commerciales controversées :

- La prise en compte de l'exposition aux activités commerciales liées au thème « Resilient Future », lequel inclut les solutions pour l'énergie propre, l'alimentation et l'agriculture alternatives, les solutions de gestion de l'eau, ainsi que la prévention et le contrôle de la pollution, mesurée par le chiffre d'affaires ou par le « Score de pertinence thématique » correspondant. Il convient de noter que le Score de pertinence thématique est conçu afin de mesurer l'importance d'un thème pour les activités commerciales de l'entreprise, et peut refléter tant les activités « en amont » (par ex., dépenses d'investissement, fusions et acquisitions) qui peuvent être glanées de sources d'information administratives telles que les dépôts de déclarations, que les flux de rentrées ou de bénéfices pertinents établis et déclarés au niveau de la branche d'activité. Le score est compris entre 0 % et 100 %.
- La prise en compte de l'implication des sociétés dans des controverses ESG (sur la base du Score de controverse ESG de MSCI) et des controverses environnementales (sur la base du Score de controverse environnementale de MSCI). Veuillez vous référer à la section « Politique d'investissement » concernant la description du « Score de controverse ESG MSCI » et du « Score de controverse environnementale MSCI ».
- La prise en compte de l'alignement des sociétés sur les ODD de l'ONU sélectionnés, selon les évaluations d'Alignement sur les ODD de MSCI.
- La prise en compte des principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité (cf. « Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? »).
- L'identification des investissements durables. Pour que le titre soit admissible comme investissement durable pour le Compartiment, la société doit être définie comme « Leader » ou « Outperformer » par le Gestionnaire d'investissement au moyen du score ESG généré dans le cadre d'un processus interne de notation ESG (le « **Score ESG** »).

En tant que tel, le Compartiment ne prévoit pas de détenir de titres qui ne répondent pas aux critères ESG pertinents ci-dessus.

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 ?

Les objectifs des investissements durables réalisés par le Compartiment sont d'investir dans des titres classés comme :

« Leaders » ou « Outperformers » par le Gestionnaire d'investissement au moyen du score ESG généré dans le cadre d'un processus interne de notation ESG (le « **Score ESG** »).

Un Score ESG est généré pour chacune des valeurs dans l'univers éligible du Compartiment au moyen du système de notation exclusif du Gestionnaire d'investissement, et ce Score ESG est utilisé dans la construction du portefeuille du

Compartiment afin d'orienter sa composition sur des titres assortis d'expositions favorables aux facteurs pertinents, ainsi qu'aux critères ESG.

Les attributions de Score ESG sont définies par notre équipe ESG sur la base du centile des entreprises notées mensuellement, réparties en cinq catégories. Les « Leaders » et « Outperformers » s'inscrivent dans les deux catégories les plus élevées du Score ESG. Les titres qui sont classés dans les catégories restantes, c.-à-d. « Average Performers », « Underperformers », « Laggards », ou non notés, ne sont pas admissibles comme Investissements durables.

Le Score ESG exploite de multiples sources de données et les aligne sur des cadres de matérialité transparents et largement reconnus, afin de générer un score ESG unique pour les sociétés cotées. Il mesure la performance des activités opérationnelles et de la gouvernance d'une société par rapport aux enjeux ESG financièrement significatifs auxquels le secteur d'activité de la société est confronté.

Le Gestionnaire d'investissement s'appuie sur les données obtenues de divers prestataires ESG et exploite le cadre de matérialité transparent et largement reconnu du Sustainable Accounting Standards Board (le « SASB ») pour générer un score unique qui mesure la performance des activités opérationnelles et de la gouvernance d'une société par rapport aux Facteurs ESG spécifiques à son secteur d'activité. Le cadre de matérialité du SASB se concentre sur la matérialité financière de certains paramètres ESG définis par un secteur d'activité donné. Le Score ESG permet d'établir une comparaison globale des performances ESG des sociétés au sein d'un secteur ou d'une industrie.

Pour que le titre soit admissible comme investissement durable, la société doit être définie comme « Leader » ou « Outperformer » par le Gestionnaire d'investissement au moyen du Score ESG généré par son processus de notation interne. Les sociétés catégorisées comme « Leaders » ou « Outperformers » sont réputées gérer et réduire les risques de durabilité à long terme et financièrement significatifs mieux que leurs homologues, et donc exploiter un modèle d'entreprise plus durable.

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 ?

Les investissements durables que le produit financier entend partiellement réaliser ne devraient pas causer de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social. À cet égard, le Gestionnaire d'investissement prend en compte les indicateurs obligatoires de principales incidences négatives (« PIN ») qui sont présentés au Tableau 1 de l'Annexe I du Règlement SFDR Niveau 2 sur les facteurs de durabilité, via l'intégration du cadre de matérialité du SASB dans son Score ESG exclusif et l'application des exclusions propres à l'Indice. En investissant dans des titres catégorisés « Leaders » ou « Outperformers » selon ce Score ESG exclusif et après application des exclusions de l'Indice, le Gestionnaire d'investissement considère que les investissements durables du Compartiment ne causent pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social.

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

Les indicateurs obligatoires de PIN sont pris en compte, tant via l'intégration du cadre de matérialité du SASB dans le Score ESG exclusif du Gestionnaire d'investissement que par l'application des filtres négatifs et normatifs dans les critères que le Gestionnaire d'investissement a établis pour qu'un titre soit admissible comme investissement durable, afin d'exclure les placements jugés préjudiciables à tout objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social. L'exclusion des titres émis par des sociétés qui, à la suite de recherches, s'avèrent contrevenir aux normes internationales en matière de protection de l'environnement, de droits humains, de normes du travail et de lutte contre la corruption est un exemple de filtrage fondé sur les normes. Un exemple de filtrage négatif est l'exclusion des titres émis par des sociétés qui, à la suite de recherches, s'avèrent être impliquées dans le domaine des armes controversées, tel qu'en dispose la Convention sur les armes à sous-munitions et/ou l'exclusion de sociétés sur la base d'autres critères ESG tels que les seuils de notation ESG.

Les sociétés catégorisées « Leaders » ou « Outperformers » d'après le Score ESG exclusif du Gestionnaire d'investissement, lequel exploite le cadre de matérialité du SASB, et qui ne sont pas exclues par les filtres négatifs et normatifs appliqués, sont considérées comme investissements durables et, par conséquent, ne pas causer de préjudice significatif à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social. Les filtres négatifs et normatifs prédéterminés sont utilisés de sorte que les titres des sociétés identifiées comme non conformes aux Principes du PMNU (concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption), ainsi que des sociétés impliquées dans de Graves controverses ESG, les armes controversées, les armes à feu civiles, le charbon thermique, l'exploration pétrolière et gazière en Arctique, l'extraction de sables bitumineux et le tabac, ne sont pas admissibles comme investissements durables.

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.

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 :

Un investissement durable, tel que défini par le Gestionnaire d'investissement, n'inclut pas les sociétés que le Gestionnaire d'investissement a jugé contrevenir aux principes du PMNU. Les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales ainsi que les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont pris en compte dans le cadre de l'évaluation des principes du PMNU.

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 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 mesure la performance des actions des marchés développés et émergents dans le monde qui répondent aux critères d'admissibilité définis dans l'Indice. En outre, l'Indice vise à exclure certaines valeurs en raison de l'implication des sociétés dans certaines activités commerciales controversées : armes controversées, tabac, armes à feu civiles, extraction de pétrole et de gaz non conventionnels, et huile de palme. Les détails complémentaires concernant la définition de ce qui constitue une « implication » sont précisés par le Fournisseur d'indice dans la méthodologie indiciaire. De même, 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 d'exploitation et/ou leurs produits et services, sur la base d'un score de controverse ESG de MSCI (le « Score de controverse ESG MSCI »). Par ailleurs, l'Indice exclut les sociétés qui présentent un défaut d'alignement notable sur les ODD de l'ONU sélectionnés.

Le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation investiront pour le compte du Compartiment, selon la stratégie de réplcation décrite plus en détail sous la section « Objectifs et politiques d'investissement – Fonds indiciaires » 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

La stratégie d'investissement

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

l'Indice. Au moins 90 % des actifs du Compartiment sont investis dans des titres qui composent l'Indice.

Les éléments contraignants de la stratégie d'investissement de l'Indice incluent entre autres :

- L'exposition aux activités commerciales liées au thème « Resilient Future », lequel inclut les solutions pour l'énergie propre, l'alimentation et l'agriculture alternatives, les solutions de gestion de l'eau, ainsi que la prévention et le contrôle de la pollution, mesurée par le chiffre d'affaires ou par le « Score de pertinence thématique » correspondant (veuillez vous référer à la section « Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ? » concernant la description du « Score de pertinence thématique »).
- L'exclusion des sociétés jugées comme i) impliquées dans des controverses ESG classées sous Drapeau rouge (Score de controverse ESG MSCI de 0) et/ou, ii) impliquées dans des controverses environnementales classées sous Drapeau rouge (Score de controverse environnementale MSCI de 0) ou Drapeau orange (Score de 1) (veuillez vous référer à la section « Politique d'investissement » concernant la description du « Score de controverse ESG MSCI » et du « Score de controverse environnementale MSCI »).
- L'exclusion des sociétés qui présentent un défaut d'alignement notable sur les ODD de l'ONU sélectionnés. Aux termes de la méthodologie indicielle, une société est catégorisée comme « Nettement désalignée » quand au moins l'un des critères suivants est rempli : i) la société génère plus de 50 % de son chiffre d'affaires de produits et services susceptibles de produire une incidence négative sur l'environnement ou la collectivité dans les domaines relevant du champ d'application des ODD de l'ONU, ou ii) s'est trouvée impliquée dans une ou plusieurs controverses classées sous Drapeau rouge et liées aux ODD de l'ONU. Pour plus d'informations concernant l'Alignement sur les ODD de MSCI, veuillez vous référer à la Méthodologie d'alignement sur les ODD de MSCI : <https://www.msci.com/documents/1296102/15233886/MSCI+SDG+Alignment+Methodology.pdf>
- L'exclusion des sociétés liées de quelque manière aux armes controversées.
- L'exclusion de sociétés en raison de leur implication dans les activités commerciales controversées suivantes : armes controversées, armes à feu civiles, tabac, extraction de charbon thermique, énergie thermique au charbon (excepté si 50 % ou plus de leur revenu global sont tirés des énergies alternatives, de la production d'énergie hydraulique, de la gestion durable de l'eau et de la protection du capital naturel), extraction de pétrole et de gaz non conventionnels, extraction de pétrole et de gaz en Arctique, huile de palme, pétrole et gaz, production d'énergie à base de combustibles fossiles. Une « implication » est définie au sens de la méthodologie indicielle comme la participation d'une société à certaines activités ou opérations commerciales controversées qui sont incompatibles avec les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. Il s'agit non seulement d'implication directe, mais aussi d'implication indirecte significative à des activités telles que la production ou la vente de ces activités commerciales controversées.

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 titres 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 indicielle de MSCI qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.msci.com/documents/10199/c2aec426-e005-1eb1-0d8e-744284b1a79a>

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. Il est prévu que, sur cette part, au moins 30 % des actifs du Compartiment soient investis dans des titres qui sont des investissements durables ayant des objectifs environnementaux et/ou sociaux au moment du rééquilibrage du portefeuille, normalement réalisé sur une base semestrielle. 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

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.



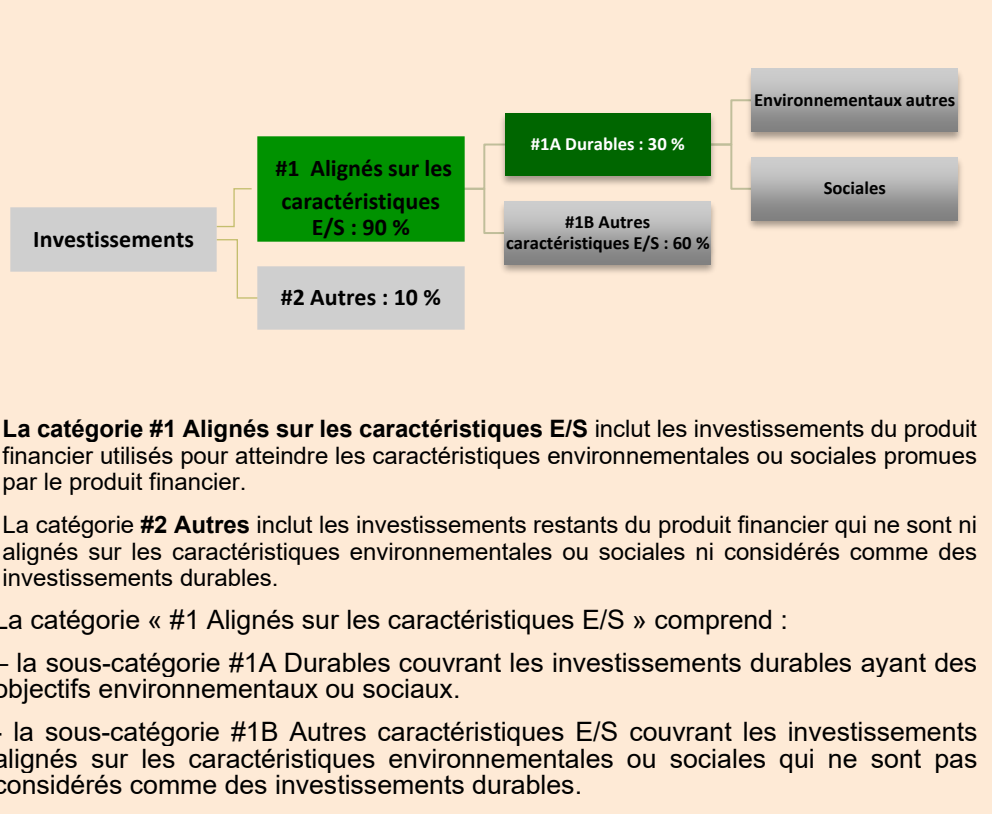
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'y aura de garanties environnementale ou sociale en place.

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

Le Compartiment ne s'engage pas explicitement à opérer une allocation distincte entre investissements durables sur le plan social et investissements durables sur le plan environnemental. Cette approche reflète la stratégie ESG plus globale du Compartiment, laquelle intègre des considérations tant environnementales que sociales dans ses critères d'investissement durable.

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.



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.

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

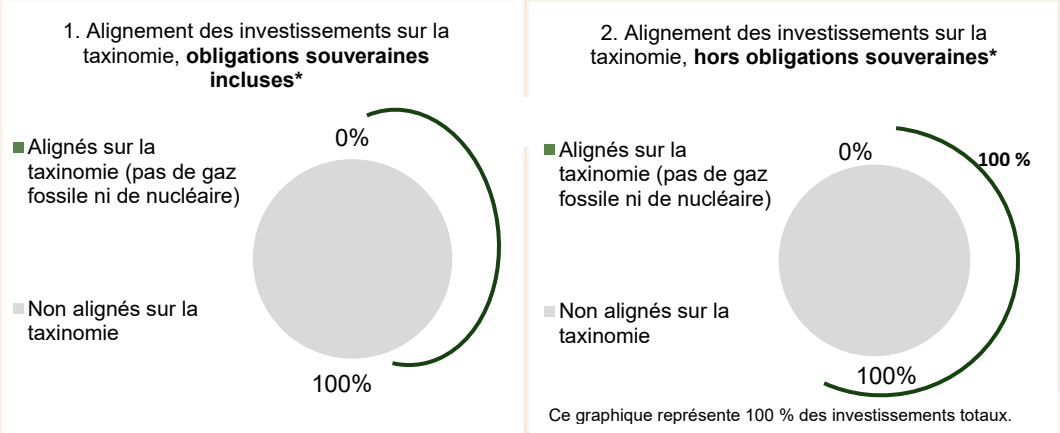
☒ **Non**

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.

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.



* 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 ?

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.



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 prévoit d'investir au minimum 0 % de ses avoirs dans des investissements durables ayant un objectif environnemental et qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE. L'évaluation des investissements du Compartiment admissibles comme durables est généralement déterminée sur une base mensuelle, lors de l'actualisation des scores ESG.



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.



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

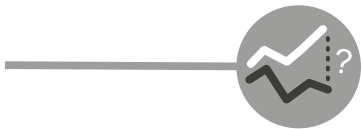
Le Compartiment prévoit d'investir au minimum 0 % de ses avoirs dans des investissements durables ayant un objectif social et qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE. L'évaluation des investissements du Compartiment admissibles comme durables est généralement déterminée sur une base mensuelle, lors de l'actualisation des scores ESG.

Bien que le Compartiment s'engage à détenir 30 % d'investissements durables, il ne s'oblige pas explicitement à opérer une allocation distincte entre investissements durables sur le plan social et investissements durables sur le plan environnemental indépendamment de cette allocation globale de 30 % aux investissements durables. Cette approche reflète la stratégie ESG plus globale du Compartiment, laquelle intègre des considérations tant environnementales que sociales dans ses critères d'investissement durable sans pour autant ventiler de répartition spécifique entre les objectifs environnementaux et sociaux ni les aligner sur la taxinomie de l'UE.



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 ?

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

Le Compartiment réplique le plus fidèlement possible la performance de l'indice MSCI ACWI IMI Resilient Future Select 35/20 Capped 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 permanente et des rééquilibrages semestriels.

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 indiciaire de MSCI.

L'Indice désigné instaure des exclusions et des modifications des pondérations indiciaires, par rapport à l'indice de marché large pertinent, qui sont fonction des caractéristiques ESG des sociétés, sur examen de leur notation ESG, de leur implication dans certaines activités commerciales controversées et de leur alignement sur les ODD de l'ONU sélectionnés, comme appliqué par le Fournisseur d'indice. 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 à la méthodologie indiciaire.

Où trouver la méthodologie utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?
<https://www.msci.com/documents/10199/c2aec426-e005-1eb1-0d8e-744284b1a79a>

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)



