

State Street CCF
(« CCF »)

**Sixième Addenda du 13 mai 2026 au Prospectus et aux Suppléments datés du 3 août 2021
concernant CCF
(l'« Addenda »)**

Le Sixième Addenda fait partie intégrante et doit être lu en parallèle du Prospectus de CCF daté du 3 août 2021, des addenda y rattachés datés du 13 décembre 2021, du 15 juin 2022, du 24 novembre 2023, du 1er avril 2025 et du 30 octobre 2025, ainsi que du Supplément de chacun des compartiments de CCF (ensemble, le « Prospectus »). Toutes les informations contenues dans le Prospectus et les Suppléments sont réputées être intégrées aux présentes.

Les administrateurs de State Street Global Advisors Europe Limited, gestionnaire de CCF, (les « **Administrateurs** ») acceptent la responsabilité des informations contenues dans le présent Addenda. À la connaissance des Administrateurs, qui ont pris toute précaution raisonnable pour s'en assurer, les informations contenues dans le présent Addenda sont conformes à la réalité des faits et n'omettent rien qui soit de nature à altérer la portée desdites informations. Les Administrateurs en assument par conséquent l'entière responsabilité.

Les termes et expressions qui ne sont pas spécifiquement définis aux présentes seront réputés correspondre aux définitions qui leur sont attribuées dans le Prospectus et les Suppléments.

Modifications apportées au Prospectus

1. La section du Prospectus intitulée « Glossaire » sera actualisée par introduction de la nouvelle définition suivante :

« Investisseur professionnel »	signifie un investisseur considéré comme un client professionnel ou susceptible d'être traité, sur demande, comme un client professionnel, au sens de l'Annexe II de la Directive 2014/65/UE ; »
---------------------------------------	--

2. La sous-section intitulée « *Suspension temporaire du calcul de la VL et des transactions* », présentée sous la section « Valorisation et calcul de la VL » du Prospectus, sera supprimée dans son intégralité et remplacée par ce qui suit :

« 6.4. Suspension temporaire du calcul de la VL et des transactions.

Le Gestionnaire aura la possibilité, en tout état de cause et après notification préalable au Dépositaire, de suspendre temporairement le calcul de la valeur liquidative, la valorisation et/ou l'émission, le rachat et la conversion des Parts d'un Compartiment dans les circonstances suivantes :

- lorsqu'une ou plusieurs Bourses ou autres marchés qui représentent la base pour la valorisation d'une part significative de la VL sont fermés ou lorsque la négociation y est suspendue ;
- lorsque le Gestionnaire est d'avis qu'il est impossible de vendre ou de valoriser des actifs en raison de circonstances particulières ;

- lorsque les technologies de communication normalement utilisées pour la détermination du prix d'un titre du Compartiment cessent de fonctionner complètement ou en partie ;
- lorsque le transfert des sommes d'achat ou de vente des investissements du Compartiment ne peut être effectué ;
- à la suite d'une décision de fusion d'un Compartiment ou de CCF, au motif valable de protéger les intérêts des Porteurs de parts ;
- lorsque le Compartiment est un fonds nourricier et que le calcul de la valeur liquidative de l'OPCVM maître (ou l'un de ses compartiments) est suspendu ;
- les conditions établies sous la section « Limites de rachat » ci-dessus sont remplies ;
- toute période durant laquelle les Administrateurs définissent que procéder ainsi sert au mieux les intérêts des Porteurs de parts.

Toute suspension de ce type sera strictement limitée à la durée nécessaire pour répondre aux circonstances exceptionnelles qui la justifient, en toute considération des intérêts des Porteurs de parts.

L'avis de ce type de suspension sera tenu d'être publié au siège social du Gestionnaire et sera transmis sans délai à la Banque centrale et aux Porteurs de parts.

La suspension du calcul de la VL par Part d'un Compartiment ou de toute opération de valorisation et/ou d'émission, de rachat et de conversion de Parts d'un Compartiment n'impliquera pas nécessairement de suspension pour les autres Compartiments non concernés par les événements en question. Les requêtes de souscription, de rachat ou de conversion de Parts déposées par les Porteurs de parts seront traitées le premier Jour de négociation consécutif à la levée de la suspension, à moins que les demandes ou requêtes de rachat aient été retirées avant la levée de la suspension. Le cas échéant, toutes les mesures raisonnables seront prises pour mettre fin aux périodes de suspension et permettre le traitement de ces ordres d'opération dès que possible. La levée d'une suspension sera notifiée sans délai à la Banque centrale. »

3. Les sous-sections intitulées « *Limites de rachat* » et « *Rachat en nature* », présentées sous la section « *Parts* » du Prospectus, seront supprimées dans leur intégralité et remplacées respectivement par ce qui suit :

« **Limites de rachat** : Si les requêtes de rachat reçues sur un Jour de négociation atteignent un total cumulé supérieur à 10 % de la Valeur liquidative d'un Compartiment, le Gestionnaire pourra reporter les requêtes de rachat excédentaires reçues sur les Jours de négociation subséquents et rachètera ces Parts au prorata. Si le Gestionnaire refuse de racheter les Parts pour ce motif, les requêtes de rachat présentées à cette date seront réduites au prorata et les Parts concernées par chaque requête et non rachetées seront reportées sur chaque Jour de négociation suivant (mais ne bénéficieront pas d'une priorité ledit Jour de négociation suivant), étant entendu que le Gestionnaire ne sera pas tenu de racheter plus de 10 % du nombre de Parts en circulation d'un Compartiment particulier sur un Jour de négociation, jusqu'à ce que toutes les Parts du Compartiment concernées par la requête initiale aient été rachetées. Le Gestionnaire appliquera cette mesure de manière temporaire, proportionnelle et systématique à l'ensemble des Porteurs de parts, et sa mise en place n'aura pas d'incidence sur la fréquence de transaction d'un Compartiment. »

« **Rachats en nature** : Le Gestionnaire est libre de choisir de racheter les Parts en nature dès lors que le Porteur de parts qui requiert le rachat en fait la demande. Tous les Porteurs de parts seront traités de manière équitable. La décision d'effectuer un rachat en espèces sera laissée à la seule discrétion du Gestionnaire lorsque le Porteur de parts cessionnaire est un Investisseur professionnel et sollicite le rachat d'un nombre de Parts qui représente 5 % ou plus de la VL d'un Compartiment. Dans ce cas, si le Porteur de parts cessionnaire le sollicite, le Gestionnaire sera libre de faciliter la vente des actifs concernés pour le compte du Porteur de parts et le coût de ladite vente sera imputé au Porteur de parts en question. Afin de lever toute ambiguïté, le consentement d'un Porteur de parts cessionnaire sera requis s'il ne s'agit pas d'un Investisseur professionnel ou s'il s'agit d'un Investisseur professionnel qui sollicite le rachat d'un nombre de Parts inférieur à 5 % de la VL du Compartiment concerné.

Sur réception d'une requête de rachat d'un Porteur de parts, le Gestionnaire décidera d'effectuer le rachat en nature, en lieu et place d'un rachat en espèces, par transfert d'investissements (et des passifs y rattachés) au Porteur de parts, sous réserve que la valeur desdits placements n'excède pas le montant qui aurait autrement été exigible sur un rachat en numéraire et sous réserve que le transfert des investissements (et passifs y rattachés) soit approuvé par le Dépositaire. Les actifs à transférer devront correspondre à une part proportionnelle des actifs détenus par le Compartiment, seront sélectionnés à la discrétion du Gestionnaire et avec l'accord du Dépositaire, et seront pris à leur valeur utilisée pour déterminer le prix des Parts ainsi rachetées. Cette valeur peut être minorée d'un montant que le Gestionnaire peut considérer comme provision appropriée (dans les limites autorisées) pour les coûts que le Compartiment aurait engagés lors du transfert direct des investissements (et des passifs y rattachés) opéré par le Gestionnaire, ou majorée d'un montant que le Gestionnaire peut considérer comme provision appropriée (dans les limites autorisées) pour les coûts que le Compartiment aurait engagés lors de la cession des investissements (et des passifs y rattachés) à transférer. Le manque à gagner (le cas échéant) entre la valeur des investissements transférés (et tous les passifs qui y sont attachés) sur un rachat par transfert d'investissements et le produit du rachat qui aurait été payable sur un rachat en numéraire, doit être pourvu en numéraire. Toute baisse de valeur des investissements à transférer en règlement d'un rachat, entre le Jour de négociation concerné et le jour où les investissements sont livrés aux Porteurs de parts cessionnaires, sera à la charge desdits Porteurs de parts. »

4. La sous-section intitulée « *Ajustement de dilution* », présentée sous la section « *Parts* » du Prospectus, sera supprimée dans son intégralité et remplacée par ce qui suit :

« **5.8. Ajustement de dilution**

Un Compartiment peut subir une dilution de la VL par Part en raison des achats et ventes de Parts des investisseurs d'un Compartiment, si le prix ne reflète pas les coûts de transaction et autres coûts engendrés lorsque les opérations sur titres sont effectuées par le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation en fonction des entrées ou sorties de liquidités. Afin d'atténuer les effets de la dilution sur les Porteurs de parts restants et de répercuter lesdits coûts sur le Porteur de parts concerné par le rachat, la souscription ou la conversion, un Ajustement de swing pricing ou un Droit anti-dilution sont susceptibles d'être appliqués pour protéger les intérêts des Porteurs de parts. Le mécanisme de dilution employé pour chaque Compartiment sera précisé dans le Supplément y afférent.

- **Ajustement de swing pricing** désigne un ajustement de la VL d'un Compartiment donné, appliqué au moyen d'un Facteur de swing pertinent comme précisé dans le Supplément concerné, et sert à refléter les coûts de transaction susceptibles d'être engagés pour un

Compartiment ainsi que les écarts cours acheteur/cours vendeur estimés des actifs dans lesquels ledit Compartiment investit, les coûts de transaction explicites et, le cas échéant, les coûts de transaction implicites (estimés au mieux) si, un Jour de négociation donné, le total cumulé des souscriptions, conversions ou rachats de Parts de toutes les Catégories d'un Compartiment entraîne une entrée ou une sortie nette de capitaux qui excède un seuil prédéterminé, défini et révisé ponctuellement par le Gestionnaire pour ledit Compartiment. Par ailleurs, le Gestionnaire pourra convenir d'inclure les charges fiscales anticipées, les coûts de transaction, l'impact sur le marché et les dépenses connexes au montant de l'ajustement. L'Ajustement de swing pricing se traduira par une majoration lorsque la variation nette entraîne une entrée nette de capitaux pour l'ensemble des Catégories d'un Compartiment et, à l'inverse, par un rabais lorsque la variation nette entraîne une sortie nette de capitaux. Étant donné que certains marchés d'actions et territoires peuvent avoir différents barèmes de frais entre les positions acheteur et vendeur, l'ajustement qui en découle pourra être différent pour les entrées nettes et pour les sorties nettes. Un examen périodique sera effectué afin de vérifier l'adéquation du Facteur de swing au regard des conjonctures de marché. Dans certaines circonstances, le Gestionnaire pourra décider que ce type d'ajustement n'est pas justifié. La volatilité de la VL du Compartiment peut ne pas refléter les performances réelles du portefeuille (et pourrait donc dévier du référentiel du Compartiment, le cas échéant) en raison de l'application d'un mécanisme de swing pricing, ou

- **Droits anti-dilution.** Dans le cadre des coûts associés à l'acquisition ou la liquidation (selon le cas) des investissements sous-jacents d'un Compartiment lors du calcul du Prix de souscription ou du Prix de rachat pour le Compartiment, le Gestionnaire peut ajuster le Prix de souscription ou de rachat sur les souscriptions ou rachats nets, quel que soit le Jour de négociation concerné, par ajout ou déduction d'un Droit anti-dilution afin de couvrir les coûts sur les opérations, les coûts d'impact sur le marché, les coûts de transaction explicites et, le cas échéant, les coûts de transaction implicites (estimés au mieux), et de préserver la valeur des actifs sous-jacents du Compartiment, à la convenance du Gestionnaire, du Gestionnaire d'investissement (ou du gestionnaire d'investissement par délégation) en fonction des conditions de marché et d'autres facteurs connexes, tels que les souscriptions ou les rachats nets du Compartiment concerné. Le Droit anti-dilution peut être utilisé pour garantir que tous les investisseurs d'un Compartiment – qu'ils souscrivent, rachètent des parts ou restent dans le Compartiment – soient traités de manière équitable, en veillant à ce que les coûts de transaction associés aux souscriptions / rachats soient imputés aux investisseurs dont les opérations sont à l'origine desdits coûts, selon ce que le Gestionnaire, le Gestionnaire d'investissement (ou le gestionnaire d'investissement par délégation) jugent approprié. »

Chaque Supplément correspondant indiquera la technique appliquée pour le Compartiment concerné. »

5. La section du Prospectus intitulée « RESTRICTIONS D'INVESTISSEMENT » sera modifiée par mise à jour de la sous-section 8.2.2.12, afin d'inclure le Gouvernement d'Arabie saoudite (sous réserve que les émissions soient notées investment grade) dans la liste des émetteurs individuels autorisés de valeurs mobilières et instruments du marché monétaire émis ou garantis dans lesquels un Compartiment peut investir 100 % de sa Valeur liquidative.