STATE STREET GLOBAL ADVISORS

# Informations clés pour l'investisseur

**Ce document fournit des informations essentielles aux investisseurs de cet OPCVM. Il ne s'agit pas d'un document promotionnel. Les informations qu'il contient vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste un investissement dans ce fonds et quels risques y sont associés. Il vous est conseillé de le lire pour décider en connaissance de cause d'investir ou non. Les termes qui ne sont pas définis ici sont tels que définis dans le Prospectus.**

# State Street Global Aggregate Bond Index Fund (le « Fonds »),

un compartiment de State Street Global Advisors Luxembourg SICAV. Ce fonds est géré par State Street Global Advisors Europe Limited.

**Catégorie d'actions : I CHF Hedged Shares (ISIN LU0956450976)**

## Objectifs et politique d'investissement

**Objectif d'investissement** L'objectif du Fonds consiste à répliquer la performance du marché obligataire mondial.
**Politique d'investissement** Le Fonds est un fonds indiciel (également connu sous le nom de fonds à gestion passive).
La politique d'investissement du Fonds consiste à répliquer la performance de l'Indice Bloomberg Barclays Global Aggregate Bond Index (ou tout autre indice déterminé de temps à autre par les Administrateurs pour répliquer dans une large mesure le même marché que l'Indice) d'aussi près que possible tout en cherchant à minimiser autant que possible l'écart de suivi entre la performance du Fonds et celle de l'Indice.
L'Indice mesure la performance du marché obligataire mondial. L'Indice comprend des obligations de sociétés, d'État et liées à des gouvernements, ainsi que des titres adossés à des actifs, adossés à des créances hypothécaires et adossés à des créances hypothécaires commerciales, d'émetteurs issus aussi bien des marchés émergents que développés. Les titres doivent avoir un taux fixe et être notés « investment grade » comme le stipule la méthodologie de l'Indice.
Le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation investiront, pour le compte du Fonds, en utilisant la Stratégie d'échantillonnage stratifié, telle que définie plus en détail à la section « Techniques d'investissement » du Prospectus, principalement dans les titres composant l'Indice, à tout moment conformément aux restrictions d'investissement exposées dans le Prospectus.
En ce qui concerne les obligations de sociétés, le Gestionnaire d'investissement utilise un filtre ESG négatif et basé sur des normes avant la construction du portefeuille du Fonds et de manière continue, tel que décrit plus en détail dans la sous-section « Filtrage ESG » de la section « Investissement ESG » du Prospectus.
Dans des circonstances exceptionnelles, le Gestionnaire d'investissement et/ou le Gestionnaire d'investissement par délégation peuvent également investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice mais dont ils estiment que les caractéristiques de risque et de distribution sont fortement similaires à celles des titres de l'Indice.
Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le présent Fonds investira uniquement dans :

- des obligations d'État et liées à des gouvernements. Le Fonds peut investir dans des obligations chinoises acquises sur le CIBM par le biais du Programme d'accès direct CIBM ;
- d'autres fonds ;
- des actifs liquides ;
- des instruments dérivés à des fins de gestion efficace du portefeuille et d'investissement. Ils se limiteront à des contrats à terme standardisés (futures), des contrats de change à terme, des options et des swaps ; et
- des titres à annoncer (To Be Announced ou « TBA »).

Le Fonds peut prêter à concurrence de 70 % des titres qu'il détient.
Les actions du Fonds sont libellées en franc suisse.
Les Actionnaires peuvent demander le rachat de leurs actions lors de tout jour ouvrable au Luxembourg et au Royaume-Uni (autre que les jours où les marchés financiers concernés sont fermés et/ou le jour précédant un tel jour à condition qu'une liste de ces jours de fermeture de marché soit publiée pour le Compartiment sur **www.ssga.com**) ; et tout autre jour à l'entière discrétion des Administrateurs (agissant dans les limites du raisonnable) pour autant que les Actionnaires en soient notifiés à l'avance.
Tout revenu enregistré par le Fonds sera retenu et traduit par une augmentation de la valeur des actions.
Pour toutes informations complémentaires, veuillez vous référer au Prospectus.

## Profil de risque et de rendement

| **Risque plus faible**<br>Rendement potentiellement plus faible | | | | | | **Risque plus élevé**<br>Rendement potentiellement plus élevé |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 2 | **3** | 4 | 5 | 6 | 7 |

**Avertissement concernant les risques** La catégorie de risque susvisée ne représente pas une mesure des plus ou moins-values, mais de l'amplitude historique des hausses et des baisses du rendement du Fonds.
Par exemple, un fonds dont le rendement a enregistré des hausses et des baisses significatives appartiendra à une catégorie de risque plus élevée, tandis qu'un fonds dont le rendement a enregistré des hausses et des baisses moins importantes appartiendra à une catégorie de risque plus basse.
Un fonds appartenant à la catégorie la plus basse (c'est-à-dire, la catégorie 1) n'est pas synonyme d'investissement sans risque.
Puisque la catégorie de risque du Fonds a été calculée à partir des données historiques, il est possible qu'elle ne représente pas une indication fiable du profil de risque futur du Fonds.
La catégorie de risque du Fonds indiquée n'est pas garantie et est susceptible de changer à l'avenir.
**Pourquoi ce Fonds est-il dans cette catégorie ?** Le Fonds est compris dans la catégorie de risque 3 car son rendement a connu historiquement des variations moyennes à la hausse comme à la baisse.
Les paragraphes ci-dessous détaillent les risques importants pour le Fonds non pris en compte dans cet indicateur.
**Risque lié à la couverture de change :** Les couvertures font parfois l'objet d'équivalences imparfaites entre l'opération de couverture et le risque que l'on tente de couvrir. Rien ne garantit que les opérations de couverture du Fonds seront efficaces. Comme le but de la couverture de change consiste à réduire ou éliminer les pertes entraînées par des variations de taux de change, elle peut également réduire ou éliminer les plus-values lorsque la devise dans laquelle le Fonds est libellé s'apprécie.
**Risque indiciel :** Il est possible que le rendement du Fonds ne corresponde pas au rendement de l'Indice. La capacité du Fonds à répliquer l'Indice sera influencée par les dépenses du Fonds, le montant de liquidités et équivalents de trésorerie détenus dans son portefeuille, et la fréquence et le moment auquel les achats et les ventes de participations dans le Fonds sont réalisés. Le Gestionnaire d'investissement peut tenter de répliquer le rendement de l'Indice en investissant dans un sous-ensemble des titres qui composent l'Indice, ou dans certains titres n'étant pas compris dans l'Indice, ce qui est susceptible d'accroître le risque d'écart entre le rendement du Fonds et celui de l'Indice.
**Risque de liquidité :** Le manque d'un marché disponible ou des restrictions à la revente peuvent limiter la capacité du Fonds à vendre un titre à un moment ou à un prix avantageux, ou tout simplement à le vendre. Les titres illiquides sont susceptibles d'être négociés avec une décote par rapport à des investissements comparables plus liquides et ils peuvent être soumis à des fluctuations considérables de leur valeur de marché. L'illiquidité des positions du Fonds peut limiter sa capacité à obtenir des liquidités pour honorer les demandes de rachat en temps voulu.
**Risque de Catégorie d'actions :** Il n'y a pas de séparation des passifs entre les Catégories du Fonds. Le Gestionnaire d'investissement s'efforcera de garantir que les plus/moins-values sur stratégie de couverture de change et les frais des instruments dérivés y étant associés soient imputés exclusivement à la Catégorie à laquelle ils s'adressent, mais les transactions pourraient entraîner des dettes pour d'autres Catégories.
**Risque lié aux investissements en République populaire de Chine (RPC) :** Outre les risques liés à l'investissement dans des marchés émergents, les risques d'investissement en RPC comprennent, entre autres, des suspensions de négociation, des restrictions de transfert/d'exposition de change, des limites sur les détentions en investissements en RPC et le recours à des courtiers, des concepts non éprouvés concernant le traitement de la propriété bénéficiaire, un recours à des Programmes d'accès susceptibles d'être arrêtés ou largement modifiés, des risques de

conservation, dont la séparation insuffisante des actifs avec ceux du titulaire de licence RQFII et Sous-dépositaire ainsi que des incertitudes fiscales.
**Risque lié au prêt de titres :** Si le Fonds réalise des prêts de titres, il existe un risque que l'emprunteur n'honore pas ses obligations de restituer des titres équivalents aux titres prêtés. Cela expose le Fonds au risque de contrepartie. Dans ce cas, le Fonds pourrait également connaître des retards lors de la récupération des titres et peut subir des pertes en capital. Le Fonds pourrait également perdre de l'argent si la valeur des garanties détenues en échange des titres prêtés diminue.
Veuillez vous reporter au Prospectus pour des informations détaillées concernant les risques liés à ce Fonds.

## Frais

Les frais et commissions acquittés servent à couvrir les coûts d'exploitation du Fonds, y compris les coûts de commercialisation et de distribution des parts. Ces frais réduisent la croissance potentielle de votre investissement.

| **Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement** | |
|---|---|
| Frais d'entrée | 0,00 % |
| Frais de sortie | 2,00 % |

Le pourcentage indiqué est le maximum pouvant être prélevé sur votre capital avant que celui-ci ne soit investi et avant que le revenu de votre investissement ne vous soit distribué.

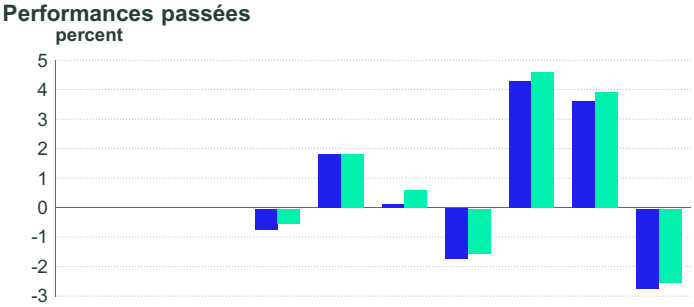
| **Frais prélevés par le fonds sur une année** | |
|---|---|
| Frais courants | 0,23 % |
| **Frais prélevés par le fonds dans certaines circonstances** | |
| Commission de performance | Aucune |

Les frais d'entrée et de sortie indiqués sont les valeurs maximales. Ainsi, il se peut que vos frais soient inférieurs – pour plus d'informations sur ce point veuillez consulter votre conseiller financier ou distributeur.
Le montant des frais courants se fonde sur les frais de l'exercice clos en décembre 2021. Ce montant peut varier d'un exercice à l'autre. Les frais courants ne comprennent pas :

- Les frais d'intermédiation excepté dans le cas de frais d'entrée / de sortie payés par le Fonds lorsqu'il achète ou vend des parts d'un autre fonds.

Pour en savoir plus sur les frais, veuillez vous reporter à la section « Frais et commissions » du Prospectus ainsi qu'au Supplément du Fonds.

## Performances passées




| | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| State Street Global Aggregate Bond Index Fund I CHF Hedged Shares (LU0956450976) | | | | -0.7 | 1.8 | 0.1 | -1.7 | 4.3 | 3.6 | -2.7 |
| Index | | | | -0.5 | 1.8 | 0.6 | -1.5 | 4.6 | 3.9 | -2.5 |

Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs.
Les performances passées présentées ici tiennent compte de l'ensemble des frais et coûts. Les frais d'entrée/de sortie sont exclus du calcul des performances passées.
Le Fonds a été lancé en juin 2013.
Les Actions de catégorie I CHF Hedged ont été lancées en avril 2014.
Les performances passées ont été calculées en franc suisse et sont exprimées sous la forme d'une variation en pourcentage de la Valeur liquidative du Fonds à la fin de chaque exercice.

## Informations pratiques

**Dépositaire** State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch.
**Autres Informations** Vous pouvez obtenir gratuitement des copies du Prospectus, de ses Suppléments ainsi que les derniers rapports annuels et semestriels préparés pour State Street Global Advisors Luxembourg SICAV en vous adressant à l'Agent administratif ou en consultant le site web **www.ssga.com**. Ces documents sont disponibles en anglais. Pour obtenir des informations sur les autres catégories d'actions, veuillez vous reporter au site web.
**Politique de rémunération** Les détails de la politique de rémunération actualisée de State Street Global Advisors Europe Limited sont disponibles sur **www.ssga.com**. Les exemplaires papier sont gracieusement mis à disposition sur demande.
**Publication de la Valeur liquidative** La Valeur Liquidative par action est disponible sur **www.ssga.com** et au siège social de la société.
**Fiscalité** Le Fonds est soumis à la législation et à la réglementation fiscales de Luxembourg. Selon votre pays de résidence, ces dernières peuvent avoir un effet sur la valeur de vos placements. Pour obtenir de plus amples informations, il vous est recommandé de consulter un conseiller fiscal.
**Déclaration de responsabilité** La responsabilité de State Street Global Advisors Europe Limited peut être engagée sur la base des déclarations contenues dans le présent document qui se révéleraient trompeuses, inexactes ou non cohérentes avec les parties correspondantes du Prospectus.

**Conversion entre compartiments** Les actionnaires peuvent convertir leurs actions en une autre catégorie d'actions du même Compartiment. La Section « Échange » du Prospectus contient des informations détaillées sur les modalités applicables aux échanges entre catégories d'actions. Les critères d'admissibilité de la Catégorie d'actions sont énumérés dans la Section « Catégories d'actions » du Prospectus.
Toute demande de conversion d'actions d'un Compartiment à un autre sera considérée comme un rachat d'un Compartiment suivi par une souscription d'un autre Compartiment.
**Séparation des Actifs et des Passifs** State Street Global Advisors Luxembourg SICAV a séparé le passif de chacun de ses compartiments. En conséquence, l'actif du Fonds ne devrait pas être disponible pour payer les dettes de tout autre compartiment de State Street Global Advisors Luxembourg SICAV.
**Réglementations relatives à la communication d'informations en matière de finance durable (Sustainable Finance Disclosure Regulations, « SFDR »)** Les informations décrivant la manière dont State Street Global Advisors Europe Limited prend en compte les risques de durabilité lors du processus d'investissement adopté dans le cadre de sa gestion du Fonds sont disponibles dans le Prospectus ou sur notre site Internet **www.ssga.com**.

Ce Fonds est agréé Luxembourg et supervisé par Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). State Street Global Advisors Europe Limited est une Société agréée par Central Bank of Ireland, sous le n° 49934. Les informations clés pour l'investisseur ici fournies sont exactes et à jour au 11 février 2022.