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 EMU ESG Screened Index Equity 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 Distributing Shares (ISIN LU1159238382)

### Objectifs et politique d'investissement

**Objectif d'investissement** L'objectif du Fonds consiste à répliquer la performance des marchés d'actions de la zone euro.
**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 MSCI EMU ex UNGC and CW 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 des actions de la zone euro. Les titres sont pondérés par la capitalisation boursière ajustée du flottant et ce, après l'exclusion de certains titres sur la base d'une évaluation de leur conformité aux critères ESG, c'est-à-dire qu'ils sont exclus en cas de non-respect des principes du Pacte mondial des Nations Unies (normes internationales relatives à l'environnement, aux droits de l'homme et aux communautés, aux droits du travail et aux chaînes d'approvisionnement, aux clients et à la gouvernance) et s'ils sont liés à des activités relatives aux armes controversées. Pour de plus amples informations, veuillez consulter la sous-section « Filtrage ESG » de la section « Investissement ESG » du Prospectus.
Le Gestionnaire d'investissement investira, pour le compte du Fonds, en utilisant la Stratégie de réplication, telle que définie plus en détail à la section « Stratégies d'investissement » du Prospectus, principalement dans les titres composant l'Indice, à tout moment conformément aux restrictions d'investissement exposées dans le Prospectus. Dans des circonstances exceptionnelles, le Gestionnaire d'investissement peut également investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice mais dont il estime que les caractéristiques de risque et de distribution sont similaires à celles des titres de l'Indice.
Le Gestionnaire d'investissement intègre le Risque de durabilité dans ses décisions d'investissement, comme décrit plus en détail dans la sous-section « Intégration ESG » de la section « Investissement ESG » du Prospectus.
Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le présent Fonds investira uniquement dans :

- des actions et titres apparentés à des actions ;
- d'autres fonds ;
- des actifs liquides ; et
- des instruments dérivés à des fins de gestion efficace du portefeuille et d'investissement. Ils se limiteront à des swaps, des options, des contrats à terme standardisés (futures) et des contrats de change à terme.

Le Fonds peut prêter jusqu'à 40 % des titres qu'il détient.
Les actions du Fonds sont émises en euro.
Le Fonds pourrait ne pas convenir aux investisseurs qui prévoient de retirer leur apport avant cinq ans.
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 généré par le Fonds sera distribué aux actionnaires à raison des actions qu'ils détiennent.
Pour toutes informations complémentaires, veuillez vous référer au Prospectus.

### Profil de risque et de rendement

**Risque plus faible**
Rendement potentiellement plus faible

**Risque plus élevé**
Rendement potentiellement plus élevé

| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | **6** | 7 |
|---|---|---|---|---|---|---|

**Avertissement concernant les risques** La catégorie de risque ci-dessus n'est pas une mesure des pertes ou des plus-values de capital, mais de l'importance des hausses et des baisses de rendement du Fonds constatées dans le temps.
Par exemple, un fonds dont les hausses et baisses de rendement ont été significatives sera classé dans une catégorie de risque supérieure, tandis qu'un fonds dont les hausses et baisses de rendement ont été moins importantes sera classé dans une catégorie de risque inférieure.
La catégorie la plus faible (c.-à-d., la catégorie 1) ne signifie pas qu'un fonds est « sans risque ».
La catégorie de risque du Fonds a été calculée sur la base de données de substitution historiques simulées et peut ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur du Fonds.
La catégorie de risque associée au Fonds n'est pas garantie et peut évoluer dans le temps.
**Pourquoi ce Fonds est-il dans cette catégorie ?** Le Fonds est compris dans la catégorie de risque 6 car son rendement a connu historiquement des variations très élevées 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.
**Intégration des Risques liés à la durabilité :** l'intégration des Risques liés à la durabilité dans le processus d'investissement du Fonds ne garantit pas l'atténuation de tout ou partie de ces risques. Toute détérioration du profil financier d'un investissement sous-jacent en raison d'un Risque lié à la durabilité peut avoir un impact négatif équivalent sur la Valeur nette d'inventaire et/ou la performance du Fonds investi.
**Risque lié à la classification du Fonds au titre du Règlement SFDR :** le Règlement SFDR est progressivement entré en vigueur à partir du 10 mars 2021 et impose de nouvelles obligations en matière de publication d'informations aux participants des marchés financiers. À la date du Prospectus, les normes techniques de réglementation (de niveau 2) du Règlement SFDR ont été publiées mais ne sont pas adoptées par la Commission européenne, et certains concepts récemment introduits par le Règlement SFDR ne font pas actuellement l'objet de normes d'exécution centralisées, de directives locales ou de pratiques de marché établies. Le Fonds a été évalué et classé de bonne foi sur la base des informations pertinentes actuellement disponibles. Compte tenu de l'évolution de ces normes et directives, les informations relatives au Règlement SFDR et la **classification** de l'**Article 8** indiquée dans le Supplément et sur le site Internet sont susceptibles d'être modifiées et peuvent ne plus s'appliquer.
**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.
**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.
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.

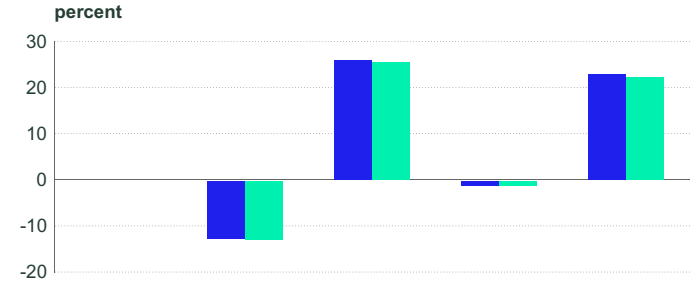
| **Frais prélevés par le fonds sur une année** | |
|---|---|
| Frais courants | 0,26 % |
| **Frais prélevés par le fonds dans certaines circonstances** | |
| Commission de performance | Aucune |

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




| | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | -12.4 | 25.9 | -0.9 | 22.9 |
| | | -12.7 | 25.5 | -1.0 | 22.3 |

State Street EMU ESG Screened Index Equity Fund I Distribution Shares (LU1159238382)
Index

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 septembre 2015.
Les Actions de catégorie I Distributing ont été lancées en août 2017.
La performance passée est calculée en euros et exprimée comme variation en pourcentage de la valeur liquidative du Fonds à chaque clôture d'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**.