

# SPDR® Russell 2000 U.S. Small Cap UCITS ETF (Acc)

Fiche produit  
Actions

31 mars 2024

## Objectif du fonds

L'objectif du fonds est de répliquer la performance de petites entreprises américaines.

## Description de l'indice

Le Russell 2000 Index est un indice pondéré par capitalisation boursière ajustée du flottant comprenant environ 2000 titres et fournissant aux investisseurs un indice de référence pour les entreprises américaines de moindre taille. L'Indice couvre approximativement 8 % de l'ensemble du marché actions américain.

## Statut Fiscal

SSGA a pour critère de satisfaire à toutes les obligations de déclaration fiscale applicables, et ce pour l'ensemble des ETF SPDR dans les pays suivants. Les demandes sont déposées tout au long de l'exercice en fonction du calendrier requis par chacune des autorités fiscales locales : R.U., Allemagne, Autriche, Suisse.

## Pays d'enregistrement

Suisse, Suède, Royaume-Uni, Pays-Bas, Norvège, Luxembourg, Italie, Irlande, France, Finlande, Espagne, Danemark, Autriche, Allemagne

## Information sur le fonds

ISIN	IE00BJ38QD84
Indice	Russell 2000® Index
Ticker Indicel	RU20N30U
Type d'Indice	Total Return Net
Nombre De Sous-Jacents	1.944

## Informations Clés

Date de lancement	30-juin-2014
Devise de Base	USD
Fonds — Devise de Base	USD
Total des Frais sur Encours	0,30%
Traitement des revenus	Accumulation
Méthode de Réplication	Optimisé
Conforme à UCITS	Oui
Domicile	Irlande
Gestionnaire	State Street Global Advisors Europe Limited
Gestionnaire délégué	State Street Global Advisors Trust Company
Ombrelle	SSGA SPDR ETFs Europe II plc
Encours de la part (en millions)	US\$2.908,22
Actifs gérés (en millions)	US\$2.908,22
Eligible ISA	Oui
Eligible SIPP	Oui
Eligible PEA	Non

Veillez noter qu'en raison de la clôture des marchés pour tous les compartiments SSGA SPDR ETF Europe I & II le vendredi 29 mars 2024, le prix du fonds reflétera la valeur liquidative du jeudi 28 mars, ce qui signifie que les performances mensuelles du fonds peuvent différer de l'indice de référence.

## Cotation

Bourse	Ticker	Devise de Transaction	Code iNAV	Code Bloomberg	Code Reuters	Code SEDOL
Deutsche Börse*	ZPRR	EUR	INZPRRE	ZPRR GY	ZPRR.DE	BJ38QG1
London Stock Exchange	R2SC	GBP	INZPRRP	R2SC LN	R2SC.L	BKRVH59
London Stock Exchange	R2US	USD	INZPRRU	R2US LN	R2US.L	BJ38QD8
SIX Swiss Exchange	R2US	CHF	INZPRRC	R2US SE	R2US.S	BN56KD6
Euronext Paris	R2US	EUR	INZPRRE	R2US FP	R2US.PA	BSTLBM8
Borsa Italiana	R2US	EUR	INZPRRE	R2US IM	R2US.MI	BRJ9D41
Bolsa Mexicana de Valores	R2USN	MXN		R2USN MM	R2USN.MX	BJCWGL9

\*Première Cotation

<b>Performance</b>					
	<b>Indice</b>	<b>Fonds Brut</b>	<b>Ecart</b>	<b>Fonds Net</b>	<b>Ecart</b>
<b>Rendements Annualisés (%)</b>					
1 An	19,19	19,45	0,26	19,09	-0,10
3 Ans	-0,49	-0,21	0,28	-0,51	-0,02
5 Ans	7,68	8,00	0,32	7,68	0,00
10 Ans	-	-	-	-	-
Depuis début	7,01	7,51	0,49	7,19	0,17
<b>Performances Cumulée (%)</b>					
1 Mois	3,53	3,56	0,04	3,54	0,01
3 Mois	5,08	5,22	0,14	5,14	0,06
1 An	19,19	19,45	0,26	19,09	-0,10
2 Ans	4,90	5,35	0,45	4,72	-0,18
3 Ans	-1,47	-0,63	0,83	-1,52	-0,06
5 Ans	44,81	46,98	2,17	44,79	-0,02
10 Ans	-	-	-	-	-
Depuis début	93,67	102,55	8,88	96,72	3,05
<b>Performances annuelles (%)</b>					
2024	5,08	5,22	0,14	5,14	0,06
2023	16,41	16,62	0,21	16,27	-0,14
2022	-20,76	-20,55	0,22	-20,78	-0,02
2021	14,49	15,04	0,55	14,70	0,20
2020	19,50	19,72	0,22	19,36	-0,14
2019	25,00	25,35	0,36	24,98	-0,02
					<b>Fonds (%)</b>
<b>Volatilité (3 Ans)</b>					21,10
<b>Tracking Error Annualisée (3 Ans)</b>					0,12

La performance passée n'est pas représentative de la performance future. Les montants bruts de commissions ne tiennent pas compte et les montants nets de commissions tiennent compte des commissions et des coûts entraînés par l'émission et le rachat de parts, ou par les achats et ventes de celles-ci. Si la performance est calculée sur la base des valeurs liquidatives brutes/nettes qui ne sont pas libellées dans la devise comptable de l'organisme de placement collectif, elle peut varier à la hausse ou à la baisse en fonction des fluctuations de change. Lorsque le Compartiment est fermé conformément à son calendrier officiel concernant la Valeur liquidative (VL), une partie significative des prix des titres sous-jacents pouvant néanmoins être déterminée, une VL technique est calculée. La performance passée indiquée ici a donc été calculée à l'aide d'une VL technique lorsque cela s'est avéré nécessaire, ainsi que la VL officielle du Fonds pour chaque autre jour ouvrable sur la période concernée. Les rendements de performance enregistrés depuis le lancement seront partiels pour l'année civile, si la date de lancement du Fonds en question, ou la date de lancement du Fonds auquel est liée la performance historique (la date retenue étant la plus proche) est incluse dans cette période.

<b>Caractéristiques</b>	
Nombre de Lignes	1.791
*Rendement des distributions	-
Ratio Cours/Bénéfice EF1	15,91
Average Price/Book	2,00
Average Market Cap (Mio)	US\$4.702,52
Rendement de l'indice	1,36%

\* Mesure l'historique du dividende versé par action sur 12 mois, divisé par la VL.  
Source : SSGA Les caractéristiques, actifs détenus, allocations géographiques et sectorielles évoquées ici sont valables à la date indiquée au début de cette fiche d'informations et sont sujets à variations. Aucune référence à une entreprise ou un titre spécifique ne doit être interprétée comme une recommandation d'achat, de vente, de détention ou d'investissement indirect dans cette entreprise ou ce titre.

<b>10 Premières Participations</b>	<b>Poids (%)</b>
SUPER MICRO COMPUTER INC	1,92
MICROSTRATEGY INC-CL A	0,96
COMFORT SYSTEMS USA INC	0,43
ELF BEAUTY INC	0,39
LIGHT & WONDER INC	0,35
ONTO INNOVATION INC	0,34
CARVANA CO	0,34
SIMPSON MANUFACTURING CO INC	0,34
VIKING THERAPEUTICS INC	0,31
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	0,31

<b>Repartition Sectorielle</b>	<b>Poids (%)</b>
Industrie	19,13
Santé	15,11
Sociétés financières	14,86
Technologie	13,92
Biens de consommation cycliques	13,14
Energie	7,72
Immobilier	5,72
Matériaux de base	3,90
Biens de consommation non-cycliques	2,67
Services aux collectivités	2,64
Télécommunications	1,19

<b>Repartition Géographique</b>	<b>Poids (%)</b>
Etats-Unis	99,89
Norvège	0,09
Canada	0,02

**Risque de capital : Investir implique des risques, dont celui d'une perte du capital.**  
Les performances passées ne constituent pas un indicateur fiable des performances futures.

## Nous contacter

Visitez notre site [ssga.com/etfs](http://ssga.com/etfs) ou contactez un représentant de l'équipe SPDR ETF France. Vous pouvez également contacter notre service client SPDR à l'adresse suivante [spdrseurope@ssga.com](mailto:spdrseurope@ssga.com).

### France & Luxembourg

[spdretf\\_france@ssga.com](mailto:spdretf_france@ssga.com)  
+33 1 44 45 40 00

### Italie

[spdretf\\_italia@ssga.com](mailto:spdretf_italia@ssga.com)  
+39 0232066 140

### Allemagne

[spdrsgermany@ssga.com](mailto:spdrsgermany@ssga.com)  
+49 69 66774 5016

### Pays-Bas

[spdr\\_nl@ssga.com](mailto:spdr_nl@ssga.com)  
+31 (0)20-7181071

### Nordics

[spdrseurope@ssga.com](mailto:spdrseurope@ssga.com)  
+31 (0)20-7181071

### Suisse

[spdrsswitzerland@ssga.com](mailto:spdrsswitzerland@ssga.com)  
+ 41 (0)44 245 70 00

### Espagne

[spdrseurope@ssga.com](mailto:spdrseurope@ssga.com)  
+39 0232066 140

### Royaume-Uni

[spdrseurope@ssga.com](mailto:spdrseurope@ssga.com)  
+44 (0) 203 395 6888

## ssga.com/etfs

### Glossaire

#### Ratio cours/bénéfices pour l'exercice

1 Moyenne du cours de chaque titre sous-jacent, divisée par l'estimation moyenne du BPA du titre pour l'exercice suivant non publié, à la date du rapport.

#### Ratio cours moyen/valeur

**comptable** Moyenne du cours de chaque titre sous-jacent, divisée par la valeur comptable par action du titre, à la date du rapport.

**Taux de dividendes de l'indice** Moyenne des dividendes par action (DPA) annuels pour chaque titre sous-jacent représenté dans l'indice, à la date du rapport, divisée par le cours du titre à la date du rapport.

**TER** Le Total des frais sur encours constitue une commission appliquée au fonds, exprimée en pourcentage de la valeur liquidative, dont l'objectif est de couvrir les coûts associés à l'exploitation et à la gestion du portefeuille d'actifs.

#### À l'usage exclusif des clients professionnels et des investisseurs qualifiés. Non destiné à la distribution publique.

Les fonds indiciels négociables en bourse (ETF) sont négociés comme des actions, sont sujets au risque d'investissement et feront l'objet de fluctuations en termes de valeur de marché. La valeur de l'investissement peut changer tant à la hausse qu'à la baisse ; le rendement sur l'investissement est donc variable en conséquence. Les variations des taux de change peuvent avoir une incidence négative sur la valeur, le cours ou le revenu d'un investissement. En outre, il ne peut être garanti qu'un ETF réalisera son objectif d'investissement.

#### Communication marketing

Les ETF SPDR sont susceptibles de ne pas être disponibles ou de ne pas vous convenir. Les informations fournies ne constituent pas des conseils d'investissement tel que ce terme est défini dans la Directive concernant les marchés d'instruments financiers (2014/65/UE) et elles ne doivent pas être invoquées en tant que telles. Elles ne constituent en aucune manière une sollicitation d'achat ou une offre de vente d'investissement. Elles ne tiennent pas compte des objectifs d'investissement, des stratégies, des situations fiscales, de l'appétit pour le risque ou des horizons d'investissement donnés des investisseurs existants ou futurs. Si vous recherchez un conseil en investissement, veuillez solliciter votre consultant fiscal et financier, ou autre conseiller professionnel.

**Veuillez consulter la dernière mise à jour du Document d'information clé (DIC)/**

**Document d'information clé pour l'investisseur (DIC) et du Prospectus du Fonds avant toute décision d'investissement. Les versions anglaises les plus récentes du Prospectus et du DIC/DICI sont consultables à l'adresse [www.ssga.com](http://www.ssga.com). Une synthèse des droits des investisseurs est disponible ici : <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights/ssga-spdr-investors-rights-summary.pdf> Veuillez noter que la Société de gestion peut décider de mettre fin aux dispositions relatives à la commercialisation et procéder à la dénotification conformément à l'art. 93a de la directive 2009/65/CE.**

Tous les documents liés aux fonds peuvent être retirés à titre gracieux auprès des bureaux du représentant ou de l'agent local, sont disponibles sur le site [www.ssga.com](http://www.ssga.com), ou peuvent être obtenus sur simple demande adressée à State Street Custodial Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irlande.

SPDR ETFs constitue la plateforme de fonds négociables en bourse (« ETF ») de State Street Global Advisors ; elle est composée de fonds agréés par les Banque centrale d'Irlande en qualité de sociétés d'investissements OPCVM à capital variable.

Les compartiments ne sont pas disponibles pour les investisseurs américains. SSGA SPDR ETFs Europe I plc et SPDR ETFs Europe II plc (« la Société »), sociétés d'investissement à capital variable de type ouvert avec une responsabilité séparée entre leurs compartiments, émettent les ETF SPDR. La Société est structurée comme un Organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) conformément à la législation irlandaise et agréée en qualité d'OPCVM par la Banque centrale d'Irlande.

**Informations complémentaires importantes - Pour le Royaume-Uni**, le présent document a été publié par State Street Global Advisors Limited (« SSGA »). SSGA est agréée et réglementée par la Financial Conduct Authority, et immatriculée sous le Numéro 2509928. N° TVA 577659181. Siège social : 20 Churchill Place, Canary Wharf, London, E14 5HJ, Téléphone : 020 3395 6000 Télécopie : 020 3395 6350 Site internet : [www.ssga.com](http://www.ssga.com). **Pour l'Union européenne**, le présent document a été publié par State Street Global Advisors Europe (« SSGA »), société réglementée par la Banque centrale d'Irlande. Adresse du siège social : 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2. Numéro d'immatriculation 49934 Tél : +353 (0)1 776 3000. Télécopieur : +353 (0)1 776 3300. Site Internet : [www.ssga.com](http://www.ssga.com).

**Pour le Mexique**, les informations figurant dans ce document ne constituent en aucun cas une offre de titres financiers et ne sauraient être considérées comme telles. Les Fonds mentionnés dans ce document ne sont et ne seront pas agréés en vertu de la Mexican Securities Market Law (Ley del Mercado de

Valores). Ils ne peuvent faire l'objet d'aucune offre publique, pas plus qu'ils ne peuvent être vendus sur le territoire des États-Unis d'Amérique. Il est interdit de distribuer publiquement les documents informatifs liés aux fonds susmentionnés sur le territoire du Mexique, tout comme il est interdit d'y échanger des parts des Fonds.

#### Représentants locaux et agents payeurs pour les ETF SPDR :

**France** : State Street Bank International GmbH Paris Branch, Cœur Défense - Tour A, 100, Esplanade du Général de Gaulle, 92931 Paris La Defense Cedex ; **Suisse** : State Street Bank GmbH Munich, Zurich Branch, Beethovenstrasse 19, 8027 Zurich, et le distributeur principal en Suisse, à savoir State Street Global Advisors AG, Beethovenstrasse 19, 8027 Zurich ; **Allemagne** : State Street Global Advisors Europe Limited, Briener Strasse 59, D-80333 Munich ; **Espagne** : Cecabank, S.A. Alcalá 27, 28014 Madrid (Espagne) ; **Danemark** : Nordea Bank Denmark A/S, Issuer Services, Securities Services Hermes Hus, Helgeshøj Allé 33 Postbox 850 DK-0900 Copenhagen C ; **Autriche** : Erste Bank, Graben 21, 1010 Vienne, Autriche ; **Suède** : SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB, Global Transaction Services ST MHI, SE-106 40 Stockholm, Suède.

Le ou les produits ne sont ni financés, approuvés, vendus ou promus par Frank Russell Company (« Russell »). Russell ne saurait faire valoir ou garantir, de manière expresse ou implicite, aux propriétaires du ou des Produits ou à quelque représentant du public que ce soit, l'opportunité d'investir dans des titres en général ou dans le ou les Produits en particulier ou la capacité de l'indice Russell 2000 Index à répliquer la performance globale du marché boursier ou d'un segment y afférent. La publication de l'indice Russell 2000 Index par Russell ne saurait suggérer ou impliquer une quelconque opinion de Russell quant à la pertinence de l'investissement sur tout ou partie des titres sur lesquels l'indice Russell 2000 Index est basé. La seule relation existante entre Russell et State Street Corporation se limite à la concession sous licence de certaines marques de commerce et dénominations commerciales de Russell et ou de l'indice Russell 2000 Index qui est déterminé, composé et calculé par Russell sans considération de State Street Corporation ou du ou des Produits. Russell ne saurait être tenue responsable de, ni avoir contrôlé le ou les Produits ou toutes autres documentations ou publications y afférentes et Russell ne saurait en faire valoir ou en garantir, de manière expresse ou implicite, l'exactitude ou l'exhaustivité ou autre. Russell se réserve le droit, à tout moment et sans préavis, de modifier, amender, liquider ou de changer de quelque autre manière l'indice Russell 2000 Index. Russell ne saurait être liée par quelque obligation ou responsabilité que ce soit relativement à l'administration, la commercialisation ou la négociation du ou des Produits. RUSSELL NE SAURAIT GARANTIR

L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE L'INDICE RUSSELL 2000 OU DES DONNÉES QU'ILS CONTIENNENT, ET RUSSELL NE SAURAIT ÊTRE TENU POUR RESPONSABLE D'AUCUNE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION Y AFFÉRENTE. RUSSELL NE SAURAIT GARANTIR, DE MANIÈRE EXPLICITE OU IMPLICITE, LES RÉSULTATS OBTENUS PAR STATE STREET CORPORATION, PAR LES INVESTISSEURS, PAR LES PROPRIÉTAIRES DU OU DES PRODUITS, OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, QUANT À L'UTILISATION DE L'INDICE RUSSELL 2000 OU DES DONNÉES QU'ILS CONTIENNENT. RUSSELL NE SAURAIT GARANTIR, DE MANIÈRE EXPLICITE OU IMPLICITE, ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE DE POTENTIEL COMMERCIAL OU D'EFFICACITÉ À DES FINS SPÉCIFIQUES OU POUR UN USAGE PARTICULIER EN CE QUI CONCERNE L'INDICE RUSSELL 2000 OU AUX DONNÉES QU'ILS CONTIENNENT. SANS LIMITATION DE CE QUI PRÉCÈDE, RUSSELL NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENU POUR RESPONSABLE DE DOMMAGES SPÉCIAUX, PUNITIFS, INDIRECTS OU CONSÉCUTIFS (Y COMPRIS LES PERTES FINANCIÈRES), QU'AND BIEN MÊME IL AURAIT EU CONNAISSANCE DE L'ÉVENTUALITÉ DE TELS DOMMAGES.

L'Indice S&P 500® est un produit de SP Dow Jones Indices LLC ou de ses filiales (« S&P DJI ») et fait l'objet d'une licence d'utilisation par State Street Global Advisors. S&P®, SPDR®, S&P 500®, US 500 et « the 500 » (les 500) sont des marques déposées de Standard & Poor's Financial Services LLC (« S&P ») ; Dow Jones® est une marque déposée de Dow Jones Trademark Holdings LLC (« Dow Jones ») et a été utilisée sous licence par S&P Dow Jones Indices ; et ces marques déposées ont été utilisées sous licence par S&P DJI et concédées en sous-licence à certaines fins par State Street Global Advisors. Le fonds n'est pas sponsorisé, approuvé, vendu ou promu par S&P DJI, Dow Jones, S&P ou leurs sociétés affiliées respectives et aucune desdites parties ne saurait faire valoir l'opportunité d'investir dans le ou lesdits produits, ni ne saurait engager une quelconque responsabilité en cas d'erreur, d'omission ou d'interruption liée à l'un de ces indices. Les marques de commerce et les marques de service référencées aux présentes appartiennent à leurs propriétaires respectifs. Les fournisseurs de données tiers ne sauraient garantir ni affirmer, sous aucune forme que ce soit, l'exactitude, l'intégrité ou l'actualité des données, et ne sauraient être tenus responsables de dommages d'aucune sorte qui seraient liés à l'usage de ces données. Ce document ne saurait être reproduit, copié ou transmis en tout ou partie, et son contenu ne saurait être communiqué à des tiers sans l'autorisation expresse écrite de SSGA.

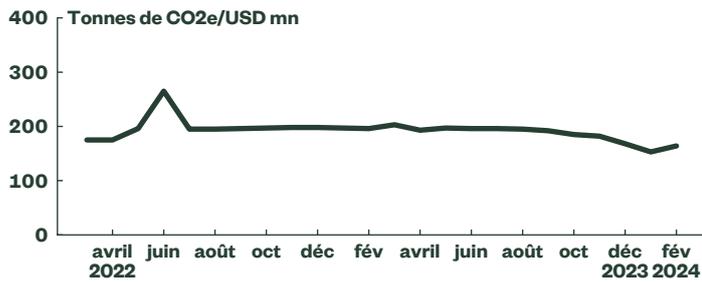
## Mesures climatiques

Mesure carbone (TCFD)	Fonds
Intensité carbone moyenne pondérée selon la TCFD (WACI)	133,95
Total des émissions carbonées (TCFD)**	259.900,78*
Empreinte carbone (TCFD)	89,58
Intensité carbone (TCFD)	136,90

Source : State Street Global Advisors, S&P Trucost, FactSet, Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (TCFD). Les résultats sont des estimations fondées sur des hypothèses et des analyses faites par State Street Global Advisors. Ils ne sont pas destinés à représenter les résultats réels d'une offre quelle qu'elle soit. Les résultats réels peuvent différer. \* La mesure du TCFD en ce qui concerne les émissions totales de CO2 affecte les émissions aux investisseurs selon une approche basée sur les parts détenues. Dans le cas de fonds amalgamés, les résultats représentent la responsabilité environnementale de la totalité des actifs sous gestion du fonds. Concernant la responsabilité des détenteurs individuels d'unités, il est possible de calculer leur proportion de responsabilité en se basant sur le pourcentage de leurs avoirs. \*\* La mesure n'est pas utilisée pour comparer les portefeuilles ou les indices de référence car les données ne sont pas normalisées.

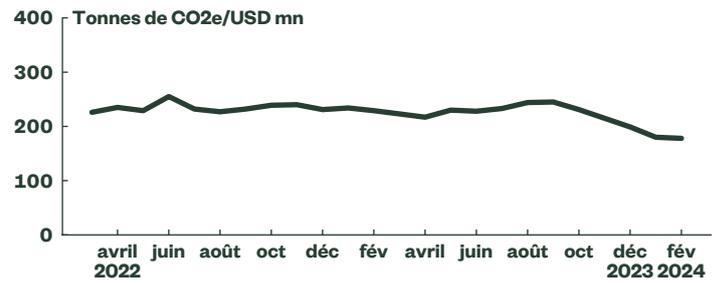
## Profil climatique

### Intensité Carbone (Directe + Indirecte)



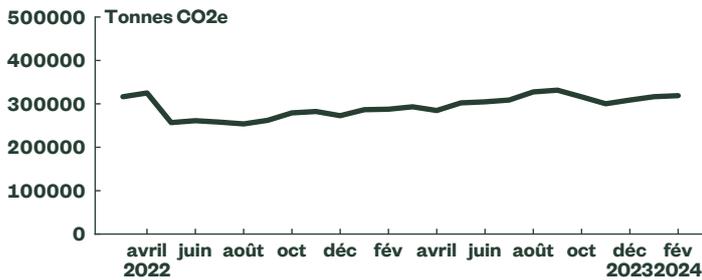
■ Fonds

### Intensité moyenne pondérée en carbone (Directe + Indirecte)



■ Fonds

### Émissions de carbone de portée 1+2



■ Fonds

Source : SSGA Holdings au 31 mars 2024. Données Trucost en date du 29 fév 2024.

## Profil d'intendance T4 2023

Nombre de rencontres ayant fait l'objet d'un vote	1.750
Nombre de pays	7
Propositions de la direction	750
Approuvé par vote	82,80%
Refusé par vote	17,20%
Propositions d'actionnaires	2
D'accord avec la direction	100,00%
En désaccord avec la direction	0,00%

Les montants représentent une agrégation cumulative d'un trimestre à l'autre à l'échelle de SSGA et ne sont pas seulement liés au fonds.

Le programme d'intendance des actifs de State Street Global Advisors (SSGA) vise à engager le dialogue avec nos sociétés de gestion de fonds au sujet de questions qui ont une incidence sur la création de valeur à long terme relativement aux considérations d'ordre environnemental, social et de gouvernance (ESG). Récemment, SSGA a publié des directives détaillées sur les questions de gouvernance clés telles que le leadership efficace et indépendant du conseil d'administration. La priorité actuelle de SSGA est d'aider les conseils d'administration à réfléchir aux impacts possibles des questions sociales et environnementales et d'intégrer un point de vue de durabilité à la supervision du conseil d'administration dans le cadre de sa stratégie à long terme à titre de pratique commerciale saine.

Diversité des sexes	
Femmes dans les conseils d'administration	Nombre de titres
0	40
1	280
2	629
3	577
4	194
5	49
6	11
7	5
8	1
9	1
10	0
Plus de 10	0
Non disponible	4
<b>Total</b>	<b>1.791</b>

Source : Factset/SSGA depuis 29 fév 2024.

## ssga.com/etfs

**Intensité des émissions de carbone (Directe+Indirecte)** Mesurée en tonnes métriques d'équivalent CO2/revenus en millions USD. L'accumulation des empreintes carbone de la chaîne d'approvisionnement d'exploitation et de premier rang des constituants de l'indice par USD (pondéré à l'identique).

**Intensité des émissions de carbone moyenne pondérée (Directe+Indirecte)** Mesurée en tonnes métriques d'équivalent CO2/revenus en millions USD. La moyenne pondérée des intensités d'une société individuelle (émissions de la chaîne d'approvisionnement d'exploitation et de premier rang par rapport aux revenus), pondérées par la part de chaque constituant dans l'indice.

**Émissions de carbone de portée 1+2** Mesurées en tonnes métriques d'équivalent CO2. Les émissions de gaz à effet de serre provenant des exploitations possédées ou contrôlées par la société, ainsi que les émissions de gaz à effet de serre (GES) provenant de la consommation d'électricité, de chaleur ou de vapeur d'eau achetées par la société.

**Intensité carbone moyenne pondérée (TCFD)** Exposition du portefeuille aux entreprises à forte intensité carbone, exprimée en tonnes CO<sub>2</sub>/million d'USD de chiffre d'affaires. Les émissions de GES des Scopes 1 et 2 sont réparties en fonction des pondérations

du portefeuille (la valeur actuelle de l'investissement par rapport à la valeur actuelle du portefeuille).

**Total des émissions carbone (TCFD)** - Les émissions absolues de gaz à effet de serre associées à un portefeuille, exprimées en tonnes CO<sub>2</sub>. Les émissions de GES des Scopes 1 et 2 sont attribuées aux investisseurs sur la base d'une approche de participation au capital.

**Empreinte carbone (TCFD)** - Total des émissions carbone d'un portefeuille normalisé par la valeur de marché du portefeuille, exprimé en tonnes CO<sub>2</sub>/million d'USD investi. Les émissions de GES des Scopes 1 et 2 sont attribuées aux investisseurs sur la base d'une approche de participation au capital.

**Intensité carbone (TCFD)** - Volume des émissions de carbone par million de dollars de chiffre d'affaires (efficacité carbone d'un portefeuille), exprimé en tonnes CO<sub>2</sub>/million d'USD de chiffre d'affaires. Les émissions de GES des Scopes 1 et 2 sont attribuées aux investisseurs sur la base d'une approche de participation au capital.

**Mixité** Nous utilisons actuellement l'ensemble de données des « collaborateurs » de FactSet, eux-mêmes pour communiquer le nombre de femmes faisant partie du conseil d'administration, dans chaque société du portefeuille du Fonds.

Les données et mesures proviennent des contributeurs énumérés ci-dessous à la date de ce rapport et font l'objet de leurs divulgations ci-après. Toutes les autres données

proviennent de SSGA.

**Sections Trucost** Intensité carbone (Directe+Indirecte), intensité des émissions de carbone moyenne pondérée (Directe+Indirecte), émissions de carbone de portée 1+2, réserves totales des émissions de CO2. Trucost™ est une marque déposée de S&P Trucost Limited ("Trucost") et est exploitée sous licence. Le rapport ESG n'est en aucune façon financé, approuvé, vendu ou promu par Trucost ou ses sociétés affiliées (conjointement les « Parties du Donneur de licence ») et aucune des Parties du donneur de licence ne saurait garantir ou faire valoir de quelque manière expresse ou implicite, (i) les résultats à obtenir de l'utilisation des données de Trucost dans le rapport, ou (ii) la pertinence des données de Trucost aux fins de laquelle elles sont rattachées au rapport. Aucune des Parties du donneur de licence ne fournit des conseils financiers ou de placement ou des recommandations relativement au rapport. Aucune des Parties du donneur de licence ne saurait être tenue responsable (au titre de négligence ou autrement) envers quiconque des erreurs de données de Trucost, et aucune des Parties du donneur de licence ne saurait être tenue de notifier quiconque des erreurs contenues dans les données.

**Sections FactSet** mixité Cette publication peut contenir des informations protégées de FactSet (« Informations de FactSet ») qui ne peuvent être reproduites, utilisées, diffusées, modifiées ou

publiées de quelque manière que ce soit sans le consentement écrit exprès de FactSet. Les informations de FactSet sont fournies « en l'état » et toutes les représentations et garanties qu'elles soient orales ou écrites, expresse ou tacites (par le régime du droit commun, par statut ou autrement), sont par la présente, exclues et rejetées, dans les mesures extrêmes permises par la loi. Plus particulièrement, en ce qui concerne les informations relatives à FactSet, FactSet décline toute garantie implicite de qualité marchande et de convenance à des fins spécifiques, ni n'en garantit l'exactitude, l'intégrité, l'actualité, la fonctionnalité et/ou la fiabilité. Les informations relatives à FactSet ne sauraient constituer un conseil en investissement et toutes opinions ou affirmations contenues dans une publication incluant des informations FactSet (et/ou les informations FactSet elles-mêmes) ne sauraient représenter les opinions ou croyances de FactSet, ses sociétés affiliées et/ou des entités liées, et/ou de leurs employés respectifs. La société FactSet ne saurait être tenue responsable de tout dommage découlant de l'utilisation, de quelque manière que ce soit, de cette publication ou des informations de FactSet qui pourraient être contenues dans ce document.

© 2024 State Street Corporation.  
Tous droits réservés.  
Date d'expiration : 31/03/2025