

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques 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 comprend pas de liste des 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 : State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund
Identifiant d'entité juridique : 549300ADYHHVDGUHHI73

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables. <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> 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 <input type="checkbox"/> 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 <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI Pacific ESG Screened Choice Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales sont promues au moyen d'un filtre négatif et basé sur des normes, appliqué à l'Indice désigné par le Compartiment pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG.

L'Indice représente la performance de l'ensemble des marchés actions développés du Pacifique (hors Japon), tout en excluant les sociétés impliquées dans les armes controversées, les armes nucléaires, les armes à feu civiles, l'extraction de combustibles fossiles, l'énergie thermique au charbon et le tabac, ou qui ne respectent pas les principes du Pacte mondial des Nations unies (le « PMNU »).

L'écart de performance sur un an au 31 décembre 2024 s'établissait à -0,03 %. L'écart de performance est conforme aux attentes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales associées est mesurée via l'exclusion par l'Indice des sociétés qui sont impliquées dans les armes controversées, les armes nucléaires, les armes à feu civiles, l'extraction de combustibles fossiles, l'énergie thermique au charbon et le tabac, et des sociétés qui ne respectent pas les principes du PMNU.

Le Compartiment ne détenait pas de titres qui ne répondaient pas aux critères ESG concernés.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

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'Union.

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.

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.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?



Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	FINANCES	8,81 %	AUSTRALIE
CSL LTD	SOINS DE SANTÉ	5,48 %	AUSTRALIE
AIA GROUP LTD	FINANCES	4,95 %	HONG KONG
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	FINANCES	4,43 %	AUSTRALIE
WESTPAC BANKING CORP	FINANCES	3,99 %	AUSTRALIE
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	FINANCES	3,44 %	AUSTRALIE
DBS GROUP HOLDINGS LTD	FINANCES	3,34 %	SINGAPOUR
WESFARMERS LTD	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	3,08 %	AUSTRALIE
MACQUARIE GROUP LTD	FINANCES	3,07 %	AUSTRALIE
HONG KONG EXCHANGES + CLEAR	FINANCES	2,54 %	HONG KONG
GOODMAN GROUP	IMMOBILIER	2,38 %	AUSTRALIE
OVERSEA CHINESE BANKING CORP	FINANCES	2,27 %	SINGAPOUR
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	ÉNERGIE	2,04 %	AUSTRALIE
UNITED OVERSEAS BANK LTD	FINANCES	1,83 %	SINGAPOUR
SEA LTD ADR	SERVICES DE COMMUNICATION	1,80 %	SINGAPOUR

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement taxinomie.

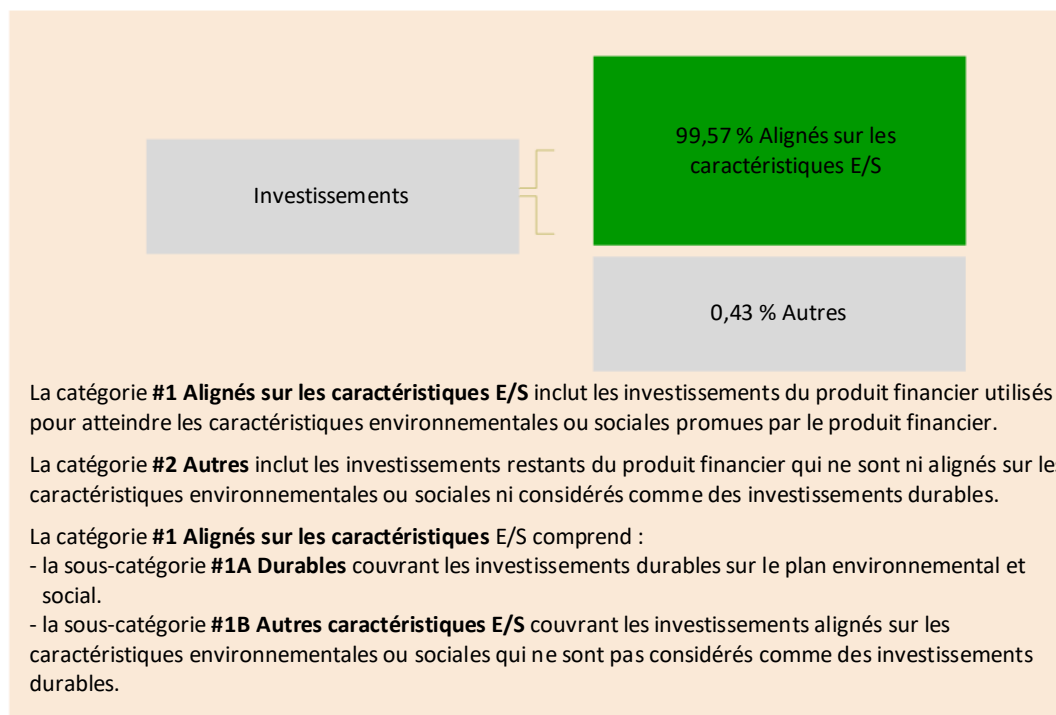
● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,57 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous.



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

0,43 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

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.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

FINANCES	44,26 %
BANQUES	29,35 %
ASSURANCE	7,98 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	6,75 %
SERVICES FINANCIERS	0,18 %
IMMOBILIER	9,56 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	3,09 %
REIT INDUSTRIELS	2,88 %
REIT COMMERCIAUX	2,23 %
REIT DIVERSIFIÉS	1,11 %
REIT DE BUREAUX	0,24 %
INDUSTRIES	8,82 %
INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	2,00 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,50 %
MACHINES-OUTILS	1,22 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,94 %
TRANSPORT TERRESTRE	0,93 %
COMPAGNIES AÉRIENNES DE TRANSPORT DE PASSAGERS	0,67 %


SERVICES PROFESSIONNELS	0,59 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,46 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,31 %
TRANSPORT MARITIME	0,20 %
SOINS DE SANTÉ	8,15 %
BIOTECHNOLOGIE	5,48 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	1,47 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	0,87 %
TECHNOLOGIE DES SOINS DE SANTÉ	0,32 %
MATÉRIAUX	6,79 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	5,53 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,92 %
PRODUITS CHIMIQUES	0,34 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	6,11 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	3,08 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	2,90 %
DISTRIBUTEURS	0,08 %
SERVICES AU CONSOMMATEUR DIVERSIFIÉS	0,04 %
SERVICES DE COMMUNICATION	5,16 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	2,09 %
DIVERTISSEMENTS	1,80 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	1,26 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	3,83 %
DISTRIBUTION DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	2,80 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	0,64 %
BOISSONS	0,38 %
ÉNERGIE	2,79 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	2,79 %
SERVICES PUBLICS	2,25 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,92 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	0,87 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,28 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	0,17 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,59 %
LOGICIELS	1,59 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

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.

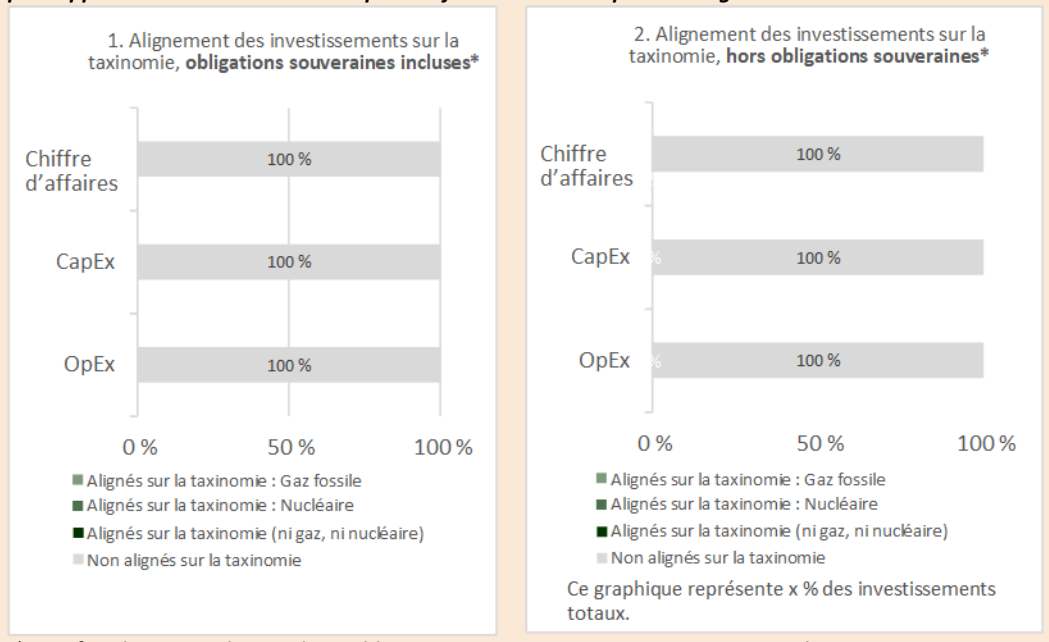
 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie.

● **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
 - En gaz fossile
 - En énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage 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 était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

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.

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 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 0,43 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI Pacific ex Japan ESG Screened Choice Index. L'Indice a été conçu aux fins de reproduire les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. L'Indice intègre des critères visant l'exclusion des sociétés qui ne respectent pas les principes du PMNU ou qui sont impliquées dans les armes controversées, les armes à feu civiles, les armes nucléaires, l'extraction de combustibles fossiles, l'énergie thermique au charbon et le tabac.

Les titres du Compartiment sont sélectionnés principalement parmi les composantes de l'Indice, tandis que le fournisseur d'Indice applique les critères d'exclusion à toutes les composantes de l'Indice. Cela se traduit par l'exclusion de tous titres considérés comme non conformes aux principes du PMNU (normes internationales relatives à l'environnement, aux droits de l'homme et aux communautés, aux droits du travail et aux chaînes d'approvisionnement, aux consommateurs et à la gouvernance). En outre, tous les titres de sociétés impliquées dans de Graves controverses ESG, les armes controversées, les armes à feu civiles, les armes nucléaires, l'extraction de combustibles fossiles, l'énergie thermique au charbon et le tabac, sont exclus de l'Indice.

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus. Le Compartiment est rééquilibré tous les trimestres, conformément à la fréquence de rééquilibrage de l'Indice.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance s'effectue au travers d'un filtrage négatif appliqué par l'Indice. Les sociétés que le fournisseur de l'Indice estime ne pas violer les Principes du PMNU sont considérées comme faisant preuve de bonne gouvernance.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?



L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI Pacific ex Japan ESG Screened Choice Index aussi étroitement que possible, tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2024, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 7,70 % sur une base brute de commissions et sous-performé de 3 point de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 7,73 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 7,39 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La performance du Compartiment était conforme aux attentes.

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/index-methodology> (code indice 731091)

● En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?

L'Indice est basé sur l'indice MSCI Pacific ex Japan Index, son indice parent, lequel couvre la représentation des grandes et moyennes capitalisations sur l'ensemble des Marchés développés de la région Pacifique (hors Japon).

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