

SPDR® Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF (Acc)

ISIN IE00BLF7VX27

Objectif du fonds

L'objectif du Fonds est de répliquer la performance du marché des obligations d'entreprise « investment grade » à taux fixe, libellées en dollars USD.

Caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG)

Le fonds intègre des caractéristiques environnementales et sociales, mais son objectif n'est pas l'investissement durable. Le fonds est catégorisé « article 8 » selon le Règlement européen (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers ("SFDR")

Le filtrage ESG s'applique à au moins 90 % du portefeuille. Il vise une notation ESG du portefeuille plus élevée que celle de l'indice Bloomberg Barclays U.S. Corporate Bond, ce filtrage éliminant de l'indice au moins les 20% de titres les moins bien notés au plan ESG.

Principales limites méthodologiques : il est possible que certaines données ESG soient incohérentes, inexactes ou inexistantes, notamment lorsqu'elles sont émises par des fournisseurs de données externes. Des détails sur ces limites sont donnés dans le Supplément.

Pour plus d'informations sur le type de caractéristiques ESG, la stratégie ESG, le processus d'investissement et le type d'approche merci de consulter le Prospectus et le Supplément du Fonds.

Description de l'indice

L'Indice est un indice de référence « investment grade » à taux fixe libellé en dollars USD qui optimise la note R-Factor™ élaborée par State Street Global Advisors®. L'Indice sélectionne des titres éligibles à partir de l'indice Bloomberg Barclays US Corporate Bond et les pondère au moyen d'un processus d'optimisation, tout en contrôlant le risque actif total. L'Indice exclut certains émetteurs en fonction de critères d'implication dans certains secteurs et/ou les émetteurs qui ne respectent pas les Principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Ticker Indiciel I35146US

Type d'Indice Total Return

Nombre De Sous-Jacents 3,334

Informations Cles

Date de début 23-oct-2020	Traitement des revenus Accumulation	Domicile Irlande	Eligible ISA Oui
Devise de Base USD	Méthode de Réplication Echantillonnage stratifié	Gestionnaire State Street Global Advisors Europe Limited	Eligible SIPP Oui
Fonds - Devise de Base USD	Conforme à UCITS Oui	Umbrella SSGA SPDR ETFs Europe I plc	Eligible PEA Non
Total des Frais sur Encours 0.15%		Actifs par catégorie d'actions (en millions) US\$5,660.49	Gestionnaire délégué State Street Global Advisors Limited
		Actifs gérés (en millions) US\$5,676.56	

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

Ces informations sont à l'attention exclusive des investisseurs professionnels des pays où le fonds est enregistré – elles ne sont destinées ni aux investisseurs particuliers, ni aux « US Persons ».

Cotation

Bourse	Exchange Ticker	Devise de Transaction	Code iNAV	Code Bloomberg	Code Reuters	Code SEDOL
Deutsche Börse*	SPPU	EUR	INSPPU	SPPU GY	SPPU.DE	BMF5B33
London Stock Exchange	USCR	USD	INSPPUU	USCR LN	USCR.L	BMTVQG5
SIX Swiss Exchange	USCR	USD	INSPPU	USCR SE	USCR.S	BLF7VX2
Bolsa Mexicana de Valores	USCRN	MXN		USCRN MM	USCRN.MX	BLH17W3

*Première Cotation

La performance du fonds n'est pas indiquée puisque la date de lancement est inférieure à 12 mois.

Caractéristiques du fonds

Nombre de Lignes	2,426	Duration effective	8.90
Maturité moyenne (en nombre d'années)	12.35	Taux de Rendement	2.01%
Convexité Effective	1.46%		

10 Premières Participations

	Poids %
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN 8.75 06/15/2030	0.95
BRITISH TELECOMMUNICATIO 9.625 12/15/2030	0.85
CISCO SYSTEMS INC 5.9 02/15/2039	0.62
CISCO SYSTEMS INC 5.5 01/15/2040	0.58
AXA SA 8.6 12/15/2030	0.53
MICROSOFT CORP 2.921 03/17/2052	0.45
HP INC 6 09/15/2041	0.42
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.65 03/24/2026	0.40
BOSTON PROPERTIES LP 4.5 12/01/2028	0.39
VODAFONE GROUP PLC 6.15 02/27/2037	0.38

Repartition Sectorielle

	Poids %
CORPORATE - INDUSTRIAL	62.87
CORPORATE - FINANCE	30.08
CORPORATE - UTILITY	6.77
Monétaire	0.27

Tranche de maturité

	Poids %
0 - 1 An	0.27
1 - 3 Ans	14.50
3 - 5 Ans	17.07
5 - 7 Ans	10.72
7 - 10 Ans	16.22
10 - 20 Ans	14.29
> 20 Ans	26.91

Répartition par Qualité

	Poids %
Aaa	2.41
Aa	8.11
A	40.69
Baa	48.79

Repartition Geographique

	Poids %		Poids %		Poids %
Etats-Unis	73.01	Pays-Bas	1.01	Italie	0.17
Royaume-Uni	10.24	Espagne	0.94	MACAU	0.10
Canada	5.48	Japon	0.64	Chili	0.06
Australie	2.15	BERMUDA	0.33	Suède	0.02
France	1.92	Suisse	0.31	TANZANIA	0.01
Belgique	1.73	Mexique	0.25		
Allemagne	1.45	Chine	0.18		

Pour plus d'informations

Visitez notre site www.ssga.com ou contactez un représentant de l'équipe SPDR ETF France

France & Luxembourg	Allemagne	Italie	Pays-Bas	Nordics	Espagne	Suisse	Royaume-Uni
spdrretf_france@ssga.com	spdrsgermany@ssga.com	spdrretf_italia@ssga.com	spdr_nl@ssga.com	spdrseurope@ssga.com	spdrseurope@ssga.com	spdrsswitzerland@ssga.com	spdrseurope@ssga.com
+33 1 44 45 40 00	+49 69 66774 5016	+39 0232066 140	+31 (0)20-7181071	+31 (0)20-7181071	+39 0232066 140	+ 41 (0)44 245 70 00	+44 (0) 203 395 6888

Vous pouvez également contacter notre service client SPDR à l'adresse suivante spdrseurope@ssga.com

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.

La qualité du crédit est basée sur une moyenne de Moody's, S&P et Fitch.

† Mesure l'historique du dividende versé par action sur 12 mois, divisé par la VL.

FACTEURS DE RISQUE

Le profil de rentabilité/risque du fonds le classe en catégorie 4, les hausses et baisses étant historiquement d'ampleur moyenne.

Les risques suivants peuvent survenir sur le fonds sans être captés de manière adéquate par la catégorie de risque.

Risque de concentration**Risque de réplique indiciel****Risque de liquidité & risque de liquidité de l'ETF****Risque de catégories d'actions****Risque de filtrage**

Pour des informations complémentaires sur les risques, veuillez consulter le Prospectus et les DICI.

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.

Le traitement fiscal dépend de circonstances particulières propres à chaque client et est sujet à des évolutions futures.

Si vous recherchez un conseil en investissement, veuillez solliciter votre consultant fiscal et financier, ou autre conseiller professionnel.

Le présent document ne constitue pas une offre ou une demande relative à l'achat d'actions dans les ETF SPDR Europe I plc et les ETF SPDR Europe II plc. Ce document doit être lu conjointement au Prospectus et au Document d'information clé pour l'investisseur (DICI). Toutes les transactions doivent s'appuyer sur les derniers Prospectus et DICI disponibles, qui contiennent davantage d'informations sur les frais et les dépenses, dès lors que les fonds sont autorisés à la vente, ainsi que sur les risques liés à votre investissement. Le Prospectus est disponible en anglais et les DICI sont traduits dans au moins une des langues officielles du pays d'enregistrement.

Le Prospectus et les DICI sont disponibles gratuitement sur : www.ssga.com

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, 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 la 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 5776591 81. Siège social : 20 Churchill Place, Canary Wharf, London, E14 5HJ, Téléphone : 020 3395 6000 Télécopie : 020 3395 6350 Site internet : www.ssga.com. **Pour l'Union européenne**, le présent document a été publié par State Street Global Advisors Europe Limited (« 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.

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 Copenhague C ; **Autriche** : Erste Bank, Graben 21, 1010 Vienne, Autriche ; **Suède** : SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB, Global Transaction Services ST MH1, SE-106 40 Stockholm, Suède.

Standard & Poor's®, S&P® et SPDR® sont des marques de commerce déposées de Standard & Poor's Financial Services LLC (S&P) ; Dow Jones est une marque de commerce déposée de Dow Jones Trademark Holdings LLC (Dow Jones) ; et ces marques déposées ont été concédées sous licence d'utilisation à S&P Dow Jones Indices LLC (SPDJI) et pour octroi de sous-licence à certaines fins à State Street Corporation. Les produits financiers de State Street Corporation ne sauraient être financés, approuvés, vendus ou promus par SPDJI, Dow Jones, S&P, leurs sociétés affiliées respectives et donneurs de licence tiers, et nulle desdites parties ne saurait faire valoir l'opportunité d'investir dans le ou lesdits produits, ni ne saurait engager une quelconque responsabilité à cet égard, en ce compris les erreurs, omissions ou interruptions rattachées à quelque indice que ce soit.

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 écrite de SSGA.

Glossaire:

Convexité effective: Mesure de la courbure de la relation entre les cours et les rendements obligataires, qui reflète la manière dont la durée d'une obligation varie en fonction des fluctuations de taux d'intérêt.

Duration effective: Calcul de durée pour les obligations qui intègrent des options. Cette mesure de la durée tient compte du fait que les flux de trésorerie prévisionnels varient au gré des fluctuations de taux d'intérêt. La durée effective peut être estimée en utilisant une durée modifiée, si une obligation qui intègre des options se comporte comme une obligation non assortie d'option.

Rendement à l'échéance: Rendement total anticipé sur une obligation, si l'obligation est détenue jusqu'à sa date d'échéance. Le rendement à l'échéance est considéré comme un rendement obligataire à long terme, mais il est exprimé en taux annuel. En d'autres termes, il s'agit du taux de rentabilité interne (RTI) d'un investissement dans une obligation, si l'investisseur détient l'obligation jusqu'à sa date d'échéance, et si tous les paiements sont réalisés selon l'échéancier prévu.

Taux de distribution: Dividendes par action (DPA) annuels du fonds, divisés par le cours de l'action du fonds.

Delta: Ce taux mesure la sensibilité des actions. Également appelé élasticité du cours, il représente la relation entre un pourcentage de variation dans le cours de l'action, et le pourcentage de variation correspondant qui est attendu en ce qui concerne le cours convertible.

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.