

State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund

State Street Global Advisors Luxembourg SICAV

Fiche produit

Obligations

30 novembre 2025

Objectif du fonds

L'objectif du Fonds consiste à répliquer la performance du marché des obligations d'État des principaux pays de la zone euro.

Stratégie d'investissement

La politique d'investissement du Fonds consiste à répliquer la performance d'un Sous-ensemble personnalisé de l'Indice Bloomberg Global Treasury Bond (Indice Euro Core) (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'autant 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 marchés des obligations d'État allemandes, françaises et néerlandaises. Les titres doivent avoir un taux fixe et être notés « investment grade » comme le stipule la méthodologie de l'Indice.

Information sur le fonds

Catégorie d'actions	[P] Tous les investisseurs
Indice	Bloomberg Global Treasury 40% Germany 40% France 20% Netherlands Custom Index
Structure	Investment Company
Conforme à UCITS	Oui
Domicile	Luxembourg

Fiche technique

ISIN	LU0570151448
Valeur liquidative	10,44 EUR au 28 novembre 2025
Devise	EUR
Actif net(en millions)	115,92 EUR au 28 novembre 2025
Date de lancement	02 mai 2012
Style de gestion	Indiciel
Zone	Economic Monetary Union/Eurozone
Règlement/livraison	Cycle de règlement des rachats, DD+2 ; Cycle de règlement des souscriptions, DD+2
Délai de notification	11 h 00 (heure d'Europe centrale) le JN
Valorisation	Clôture journalière du marché
Swing Factor ¹	
Souscription	0,01%
Rachat	0,01%
Souscription initiale	EUR 50,00
Souscriptions ultérieures	EUR 50,00
Frais de Gestion	0,3%
Actuel TER	0,37%
Frais payés au fonds	Souscription: N/A Rachat: Maximum 2%

¹ Indicatif à la date de cette fiche informative, sujet à modification

Performance					
	Indice	Fonds Brut	Ecart	Fonds Net	Ecart
Annualisé (%)					
1 An	-1,67	-1,64	0,03	-2,02	-0,35
3 Ans	0,36	0,39	0,03	0,02	-0,34
5 Ans	-3,62	-3,59	0,02	-3,94	-0,32
Depuis début	0,67	0,68	0,01	0,31	-0,35
Cumulé (%)					
1 Mois	-0,15	-0,15	0,00	-0,18	-0,03
3 Mois	0,97	0,98	0,02	0,88	-0,08
1 An	-1,67	-1,64	0,03	-2,02	-0,35
3 Ans	1,08	1,17	0,09	0,05	-1,02
5 Ans	-16,83	-16,72	0,11	-18,20	-1,38
Depuis début	9,44	9,61	0,16	4,36	-5,08
Calendrier (%)					
2025 (YTD)	-0,13	0,01	0,14	-0,35	-0,22
2024	0,11	0,03	-0,08	-0,33	-0,44
2023	6,09	6,13	0,03	5,76	-0,33
2022	-18,80	-18,78	0,03	-19,07	-0,26
2021	-3,43	-3,43	0,01	-3,76	-0,32

Les performances passées constituent une information et ne préjugent pas de l'évolution future.

Investir implique des risques, dont le risque de perte du capital.

Les chiffres de performance contenus dans ce document sont fournis sur une base brute et nette des frais de base. Les chiffres bruts de frais ne reflètent pas la déduction des frais de conseil ou autres susceptibles de réduire le rendement. Les rendements des indices reflètent les gains et pertes en capital, le revenu et le réinvestissement des dividendes. La performance comprend le réinvestissement des dividendes et les autres bénéfices des entreprises, et est calculée dans la devise indiquée dans la fiche détaillée du fond.

Les rendements de performance enregistrés depuis le lancement seront partiel 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.

La méthode de calcul des rendements en valeur ajoutée peut faire apparaître des écarts d'arrondis.

Lorsque le Fond est fermé conformément à son calendrier officiel concernant la Valeur liquidative (VL), mais avec 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.

Avant le 1 décembre 2021, l'indice du fonds était le Customised Subset of the Bloomberg Barclays Global Treasury Bond Index (Euro Core Index).

Source: State Street Investment Management.

Toutes les données sont au 30/11/2025

Caractéristiques

	Fonds	Indice
Nombre de Lignes*	145	139
Average Yield To Worst (%)	2,70	2,70
Taux de Rendement (%)	2,70	2,70
Rendement Actuel (%)	2,09	2,03
Coupon moyen (%)	2,08	2,00
Option Adjusted Spread (Bps)	22,06	21,89
Duration effective (Ans)	7,42	7,42
Maturité moyenne (Ans)	8,87	8,85
Convexité Effective	1,04	1,04
Qualité de crédit moyenne	AA2	AA2

* Le nombre d'émetteurs peut aussi inclure les positions de cash.

Ratios	3 Ans
Ecart type (%)	5,80
Erreur de suivi (%)	0,16
Bêta	1,00

Répartition par pays

	Fonds (%)	Indice (%)
France	39,99	40,00
Allemagne	39,98	40,00
Pays-Bas	19,97	20,00
Union européenne	0,06	-
Etats-Unis	0,00	-
Royaume-Uni	0,00	-
Total	100,00	100,00

Répartition sectorielle

	Fonds (%)	Indice (%)
Dette Souveraine	99,94	100,00
Monétaire	0,06	-
Total	100,00	100,00

Répartition qualité crédit

	Fonds (%)	Indice (%)
Aaa	60,01	60,00
A	39,99	40,00
Total	100,00	100,00

Répartition maturité

	Fonds (%)	Indice (%)
0 - 1 An	0,06	-
1 - 3 Ans	23,51	23,55
3 - 5 Ans	19,46	19,94
5 - 7 Ans	11,97	11,84
7 - 10 Ans	17,42	17,11
10 - 20 Ans	15,51	15,71
> 20 Ans	12,07	11,85

Source: State Street Investment Management.

Les caractéristiques, Répartition qualité crédit, allocations par pays et secteurs représentés le sont à la date indiquée en haut de la fiche produit et sont susceptibles de changer.

Dans l'allocation par pays, le terme « Autre » désigne la consolidation de tous les pays qui ne sont pas déjà inclus dans le top 10 du Compartiment.

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

Veuillez noter que le détail complet des participations sous-jacentes du fonds se trouve sur statestreet.com/im.

Nous contacter

Visitez notre site web statestreet.com/im ou contactez un bureau State Street Investment Management.

Belgium

+32 (0) 2 663 2016

Middle East & Africa

+971 2 245 9000

France

+33 (0) 1 44 45 40 48

Netherlands

+31 (0) 20 718 1701

Germany

+49 (0) 89 55878 999

Switzerland

+41 (0) 44 245 7099

Ireland

+353 (1) 776 3000

United Kingdom

+44 (0) 20 3395 2333

Italy

+39 02 3206 6121

statestreet.com/im

Communiqué commercial
Accès général. À l'usage exclusif des clients professionnels.

State Street Global Advisors (SSGA) porte désormais le nom de State Street Investment Management. Veuillez consulter statestreet.com/investment-management pour plus d'informations.

Ce document sert à des fins d'informations privées. 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) ou dans la réglementation suisse applicable et elles ne doivent pas être invoquées en tant que telles. Il n'y a aucune représentation ou garantie quant à l'exactitude de ces informations et State Street décline toute responsabilité vis-à-vis des décisions fondées sur celles-ci.

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

l'investisseur (DICI) et du Prospectus du Fonds avant toute décision d'investissement. Les versions anglaises les plus récentes du Prospectus et du DICI sont consultables à l'adresse www.statestreet.com/im. Une synthèse des droits des investisseurs est disponible ici : <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights/ssga-investors-rights-summary-template-non-etf-Lux.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.

Cette communication est destinée aux clients professionnels (ce qui inclut les Contreparties éligibles) qui sont considérés comme à la fois compétents et expérimentés en matière d'investissements.

Les informations contenues dans le présent document ne constituent pas une recommandation basée sur des travaux de recherche ou un « produit de recherche d'investissement » et sont considérées comme une « communication marketing » en vertu de la réglementation régionale

applicable. Cette communication marketing (a) n'a donc pas été préparée conformément aux dispositions légales visant à promouvoir l'indépendance de la recherche en investissement et (b) n'est de ce fait soumise à aucune disposition interdisant la négociation préalable à la diffusion de recherche en investissement. Cet organisme de placement collectif et son distributeur sont agréés par l'Autorité fédérale suisse de surveillance des marchés financiers (FINMA) conformément à la Loi fédérale suisse sur les placements collectifs de capitaux (« LPCC », ou « CISA » en anglais) et à l'Ordonnance suisse sur les placements collectifs de capitaux (« OPCC », ou « CISO » en anglais). L'organisme de placement collectif est structuré sous forme d'Organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) sous le régime de la législation du Luxembourg, et agréé comme OPCVM par la Commission de surveillance du secteur financier (CSSF). Les futurs investisseurs peuvent se procurer le prospectus actuel, les statuts constitutifs, le DICI ainsi que les derniers rapports annuel et semestriel, sans frais, auprès du Représentant suisse

et Agent payeur, State Street Bank International GmbH, Munich, Zurich Branch, Beethovenstrasse 19, 8027 Zurich. « Bloomberg » et tous les indices Bloomberg sont des marques de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses filiales, y compris Bloomberg Index Services Limited (« BISL »), l'administrateur de l'indice (collectivement, « Bloomberg ») et ont fait l'objet d'une licence d'utilisation à certaines fins par State Street Bank and Trust Company, par le biais de sa division State Street Global Advisors (« SSGA »). Bloomberg n'est pas affiliée à SSGA, et Bloomberg n'approuve, ne promeut, n'évalue ni ne recommande aucun produit SSGA. Bloomberg ne garantit aucunement le caractère opportun, ni l'exhaustivité ou l'exhaustivité des données ou informations, quelles qu'elles soient, relatives à un produit SSGA, quel qu'il soit.

Ce travail ne saurait être reproduit, copié ou transmis en tout ou partie, ni son contenu communiqué à des tiers sans l'autorisation expresse écrite de SSGA.

© 2025 State Street Corporation.
Tous droits réservés.
Date d'expiration : 19/01/2026