State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund

State Street Global Advisors Luxembourg SICAV

Fiche produit
Obligations

31 octobre 2026

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'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 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	[I Distributing] Investisseurs institutionnels
Indice	Bloomberg Global Treasury 40% Germany 40% France 20% Netherlands Custom Index
Structure	Investment Company
Conforme à UCITS	Oui
Domicile	Luxembourg

Fiche technique	
ISIN	LU0773064802
Valeur liquidative	8,98 EUR au 30 octobre 2026
Devise	EUR
Actif net(en millions)	94,49 EUR au 30 octobre 2026
Date de lancement	31 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 3 000 000,00
Souscriptions ultérieures	EUR 1 000,00
Frais de Gestion	0,15%
Actuel TER	0,22%
Frais payés au fonds	Souscription: N/A Rachat: Maximum 0%

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

Performance					
	Indice	Fonds Brut	Ecart	Fonds Net	Ecart
Annualisé (%)					
1 An	-3,09	-3,05	0,04	-3,26	-0,17
3 Ans	1,16	1,19	0,03	0,97	-0,18
5 Ans	-3,48	-3,45	0,03	-3,65	-0,17
Depuis début	0,17	0,18	0,01	-0,02	-0,19
Cumulé (%)					
1 Mois	1,12	1,12	0,00	1,11	-0,01
3 Mois	-1,71	-1,72	0,00	-1,77	-0,06
1 An	-3,09	-3,05	0,04	-3,26	-0,17
3 Ans	3,51	3,62	0,11	2,95	-0,56
5 Ans	-16,23	-16,09	0,14	-16,95	-0,73
Depuis début	2,49	2,69	0,20	-0,33	-2,82
Calendrier (%)					
2026 (YTD)	-2,18	-2,14	0,05	-2,31	-0,13
2025	-0,90	-0,77	0,13	-0,99	-0,09
2024	0,11	0,04	-0,07	-0,17	-0,28
2023	6,09	6,12	0,02	5,91	-0,19
2022	-18,80	-18,78	0,03	-18,94	-0,14

Les données de performance présentées se rapportent aux performances passées. Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs. 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 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.
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 leCustomised Subset of the Bloomberg Barclays Global Treasury Bond Index (Euro Core Index).
Source: State Street Investment Management.
Toutes les données sont au 31/10/2026

Caractéristiques		
	Fonds	Indice
Nombre de Lignes*	148	143
Average Yield To Worst (%)	3,73	3,72
Taux de Rendement (%)	3,73	3,72
Rendement Actuel (%)	2,54	2,38
Coupon moyen (%)	2,36	2,20
Option Adjusted Spread (Bps)	50,49	49,97
Duration effective (Ans)	7,14	7,14
Maturité moyenne (Ans)	8,88	8,77
Convexité Effective	0,95	0,96
Qualité de crédit moyenne	AA2	AA2

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

Ratios	3 Ans
Ecart type (%)	4,91
Erreur de suivi (%)	0,16
Bêta	1,00

Répartition par pays		
	Fonds (%)	Indice (%)
Allemagne	40,06	40,00
France	39,85	40,00
Pays-Bas	20,03	20,00
Union européenne	0,07	-
Etats-Unis	0,00	-
Royaume-Uni	0,00	-
Total	**100,00**	**100,00**

Répartition sectorielle		
	Fonds (%)	Indice (%)
Dette Souveraine	99,93	100,00
Monétaire	0,07	-
Total	**100,00**	**100,00**

Répartition qualité crédit		
	Fonds (%)	Indice (%)
Aaa	60,15	60,00
A	39,85	40,00
Total	**100,00**	**100,00**

Répartition maturité		
	Fonds (%)	Indice (%)
0 - 1 An	0,07	-
1 - 3 Ans	21,90	22,53
3 - 5 Ans	19,76	19,83
5 - 7 Ans	12,12	12,08
7 - 10 Ans	17,27	17,57
10 - 20 Ans	17,18	16,19
> 20 Ans	11,70	11,80

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

France
+33 (0) 1 44 45 40 48

Germany
+49 (0) 89 55878 999

Ireland
+353 (1) 776 3000

Italy
+39 02 3206 6121

Middle East & Africa
+971 2 245 9000

Netherlands
+31 (0) 20 718 1701

Switzerland
+41 (0) 44 245 7099

United Kingdom
+44 (0) 20 3395 2333

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 (DIC)/ 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 DIC/ 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.
State Street Global Advisors Luxembourg SICAV (la « Société ») est une société d'investissement à capital variable dont les différents compartiments sont distincts en termes de responsabilité. La Société est constituée en tant qu'organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) de droit luxembourgeois et agréée en tant qu'OPCVM par la Commission luxembourgeoise de surveillance du secteur financier (CSSF). La Société peut, de temps à autre et avec l'accord préalable de la CSSF, créer différents compartiments représentant des portefeuilles d'actifs distincts, chaque compartiment pouvant être composé d'une ou de plusieurs catégories de parts, notamment, le cas échéant, des parts négociées en bourse. L'organisme de placement collectif mentionné dans le présent document est soumis au droit luxembourgeois. Les investisseurs intéressés peuvent obtenir gratuitement le prospectus en vigueur, les statuts, les prospectus simplifiés ainsi que les derniers rapports annuels et semestriels auprès du représentant et agent payeur suisse, State Street Bank International GmbH Munich, succursale de Zurich, Kalanderplatz 5, 8045 Zurich, ainsi qu'auprès du distributeur principal en Suisse, State Street Global Advisors AG, Kalanderplatz 5, 8045 Zurich. Avant tout investissement, veuillez lire le prospectus et le DIC, dont vous pouvez obtenir des exemplaires auprès du représentant suisse, ou sur le site www.statestreet.com/im.
« 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'exactitude 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 State Street Investment Management.

© 2026 State Street Corporation.
Tous droits réservés.
Date d'expiration :20/12/2026