

Obligations

31 mars 2021

Catégorie d'actions

[B] Investisseurs institutionnels ayant souscrit une CDGF avec SSGA

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 Barclays 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.

Indice

Customised Subset of the Bloomberg Barclays Global Treasury Bond Index (Euro Core Index)

Structure

Investment Company

Conforme à UCITS

Domicile

Luxembourg

Fiche technique

ISIN	LU0773064984
Valeur liquidative	12,60 EUR au 31 mars 2021
Devise	EUR
Actif net(en millions)	647,26 EUR au 31 mars 2021
Date de début	29 juin 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 10 000 000,00
Souscriptions ultérieures	EUR 5 000,00
Frais de Gestion	0%
Actuel TER	0,05%
Commission	Souscription Rachat
Acquise au fonds	N/A Maximum 2%

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

Performance

Annualisé	Indice	Fonds Brut	Ecart	Fonds Net	Ecart
1 An (%)	-0,64	-0,62	0,02	-0,66	-0,02
3 Ans (%)	2,11	2,11	0,00	2,06	-0,05
5 Ans (%)	1,24	1,25	0,01	1,19	-0,05
Depuis début (%)	2,73	2,74	0,01	2,68	-0,05
Cumulé					
1 Mois (%)	-0,08	-0,08	0,00	-0,09	-0,01
3 Mois (%)	-2,81	-2,81	0,00	-2,82	-0,01
1 An (%)	-0,64	-0,62	0,02	-0,66	-0,02
3 Ans (%)	6,46	6,47	0,01	6,31	-0,14
5 Ans (%)	6,35	6,38	0,03	6,09	-0,26
Depuis début (%)	26,54	26,68	0,13	26,03	-0,51
Calendrier					
2021 (year to date)	-2,81	-2,81	0,00	-2,82	-0,01
2020	3,76	3,71	-0,06	3,65	-0,11
2019	4,10	4,20	0,10	4,15	0,06
2018	1,89	1,86	-0,04	1,81	-0,09
2017	-0,56	-0,55	0,01	-0,63	-0,07

Les performances passées constituent une information et ne préjugent pas de l'évolution future. Investir implique des risques, dont le risque de perte de 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.

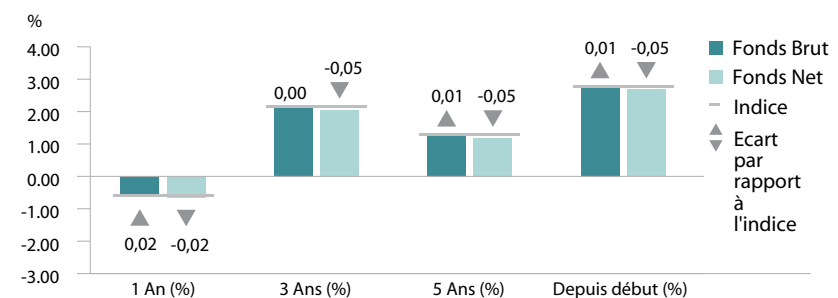
La méthode de calcul des rendements en valeur ajoutée peut faire apparaître des écarts d'arrondis.

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.

Source: SSGA.

Toutes les données sont au 31/03/2021

Performance annualisée



Caractéristiques du fonds

	Fonds	Indice
Nombre de Lignes*	124	123
Average Yield To Worst (%)	-0,29	-0,28
Taux de Rendement (%)	-0,29	-0,29
Rendement Actuel (%)	1,41	1,40
Coupon moyen (%)	1,94	1,93
Option Adjusted Spread (Bps)	11,77	11,79
Duration effective (Ans)	8,82	8,83
Maturité moyenne (Ans)	10,05	10,04
Convexité Effective	1,45	1,45
Qualité de crédit moyenne	AA1	AA1

Ratios

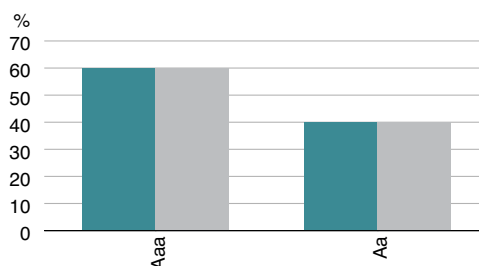
	3 Ans
Ecart type (%)	3,90
Erreur de suivi (%)	0,07
Bêta	1,00

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

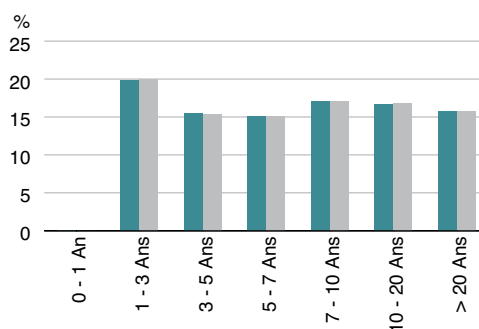
Répartition par pays	Fonds (%)	Indice (%)
Allemagne	39,99	40,00
France	39,97	40,00
Pays-Bas	19,99	20,00
Union européenne	0,05	-
Total	100,00	100,00

Répartition qualité crédit	Fonds (%)	Indice (%)
Aaa	60,03	60,00
Aa	39,97	40,00
Total	100,00	100,00

Répartition sectorielle	Fonds (%)	Indice (%)
Dette Souveraine	99,95	100,00
Monétaire	0,05	-
Total	100,00	100,00



Répartition maturité	Fonds (%)	Indice (%)
0 - 1 An	0,05	-
1 - 3 Ans	19,80	19,95
3 - 5 Ans	15,44	15,31
5 - 7 Ans	15,16	15,16
7 - 10 Ans	17,12	17,06
10 - 20 Ans	16,68	16,77
> 20 Ans	15,75	15,75



Source : SSGA.

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.

VEUILLEZ NOTER QUE LE DÉTAIL COMPLET DES PARTICIPATIONS SOUS-JACENTES DU FONDS SE TROUVE SUR WWW.SSGA.COM

Communiqué commercial – Accès général

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.

Les compartiments ne sont pas disponibles pour les investisseurs américains. **Ce document doit être lu conjointement au Prospectus et au Document d'information clé pour l'investisseur (« DICI »).** Toutes les transactions doivent être fondées sur les derniers Prospectus et DICI disponibles, qui contiennent davantage d'informations concernant les frais, les dépenses et les risques liés à votre investissement.

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 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. Cela signifie que cette communication marketing (a) n'a pas été préparée conformément aux exigences juridiques visant à promouvoir l'indépendance de la recherche en investissement (b) n'est pas soumise à une interdiction de transactions quelconque avant la diffusion de la recherche en investissements.

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.

© 2020 Morningstar, Inc. Tous droits réservés. Les informations contenues ici : (1) sont propriété exclusive de Morningstar et/ou de ses fournisseurs de contenus d'informations ; (2) ne sauraient être recopiées ou distribuées ; et (3) ne sont pas forcément exactes, exhaustives ou à jour. Ni Morningstar, ni ses fournisseurs de contenus d'informations ne sauraient être tenus responsables de tout préjudice ou de toute perte résultant de l'utilisation de ces informations.

BLOOMBERG®, une marque commerciale et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses affiliés, et BARCLAYS, une marque commerciale et de service de Barclays Bank Plc, ont chacune été concédées sous licence d'utilisation quant à la cotation des indices Bloomberg/Barclays.

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.

Pour plus d'informations

Visitez notre site web www.ssga.com ou contactez un bureau SSGA.

SSGA Belgium

+32 (0) 2 663 2016

SSGA France

+33 (0) 1 44 45 40 48

SSGA Germany

+49 (0) 89 55878 999

SSGA Ireland

+353 (1) 776 3188 / +353 (1) 776 3029

SSGA Italy

+39 02 3206 6121

SSGA Middle East & Africa

+971 2 245 9000

SSGA Netherlands

+31 (0) 20 718 1701

SSGA Switzerland

+41 (0) 44 245 7099

SSGA United Kingdom

+44 (0) 20 3395 2333