

State Street EMU Government Bond Index Fund

State Street Global
Advisors Luxembourg
SICAV

Fiche produit
Obligations

30 novembre 2025

★ ★ ★

Morningstar Rating™

Au 30 novembre 2025

Objectif du fonds

L'objectif du Fonds consiste à répliquer la performance du marché des obligations d'État libellées en euro.

Stratégie d'investissement

La politique d'investissement du Fonds consiste à répliquer la performance de l'Indice FTSE EMU Government Bond (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 libellées en euro. 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	[B] Institutional Investors who have entered into a Qualifying Agreement
Indice	FTSE EMU Government Bond Index
Structure	Investment Company
Conforme à UCITS	Oui
Domicile	Luxembourg

Fiche technique

ISIN	LU0773065015
Valeur liquidative	12,29 EUR au 28 novembre 2025
Devise	EUR
Actif net(en millions)	329,84 EUR au 28 novembre 2025
Date de lancement	12 septembre 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	0.03%
Rachat	0.00%
Souscription initiale	EUR 10 000 000,00
Souscriptions ultérieures	EUR 5 000,00
Frais de Gestion	0%
Actuel TER	0,05%
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	-0,25	-0,21	0,04	-0,22	0,02
3 Ans	1,72	1,79	0,07	1,78	0,06
5 Ans	-2,76	-2,72	0,04	-2,75	0,02
Depuis début	1,59	1,62	0,02	1,57	-0,02
Cumulé (%)					
1 Mois	-0,04	-0,04	0,00	-0,01	0,03
3 Mois	1,34	1,36	0,01	1,37	0,03
1 An	-0,25	-0,21	0,04	-0,22	0,02
3 Ans	5,24	5,47	0,23	5,43	0,19
5 Ans	-13,08	-12,88	0,20	-13,00	0,08
Depuis début	23,25	23,64	0,39	22,85	-0,40
Calendrier (%)					
2025 (YTD)	1,17	1,28	0,11	1,27	0,09
2024	1,86	1,79	-0,07	1,76	-0,10
2023	7,16	7,35	0,19	7,40	0,24
2022	-18,52	-18,50	0,02	-18,54	-0,02
2021	-3,54	-3,55	-0,01	-3,60	-0,06

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 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.

Veuillez noter que l'indice de référence était l'indice Barclays Euro Treasury Bond jusqu'au 12 septembre 2013.

Source: State Street Investment Management.

Toutes les données sont au 30/11/2025

Caractéristiques		
	Fonds	Indice
Nombre de Lignes*	387	410
Average Yield To Worst (%)	2,81	2,80
Taux de Rendement (%)	2,81	2,80
Rendement Actuel (%)	2,76	2,65
Coupon moyen (%)	2,54	2,38
Option Adjusted Spread (Bps)	33,33	32,87
Duration effective (Ans)	7,15	7,15
Maturité moyenne (Ans)	8,80	8,74
Convexité Effective	0,96	0,97
Qualité de crédit moyenne	A1	A1

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

Ratios	3 Ans
Ecart type (%)	5,72
Erreur de suivi (%)	0,08
Bêta	1,00

Répartition par pays		
	Fonds (%)	Indice (%)
France	24,43	24,45
Italie	23,08	23,10
Allemagne	19,55	19,57
Espagne	14,60	14,62
Belgique	5,13	5,14
Pays-Bas	4,27	4,29
Autriche	3,62	3,60
Portugal	1,99	2,01
Finlande	1,78	1,76
Irlande	1,46	1,45
Autres	0,10	0,00
Total	100,00	100,00

Répartition sectorielle		
	Fonds (%)	Indice (%)
Dette Souveraine	99,90	100,00
Monétaire	0,10	-
Total	100,00	100,00

Répartition qualité crédit		
	Fonds (%)	Indice (%)
Aaa	23,92	23,86
Aa	11,98	11,95
A	41,02	41,09
Baa	23,08	23,10
Total	100,00	100,00

Répartition maturité		
	Fonds (%)	Indice (%)
0 - 1 An	0,10	-
1 - 3 Ans	21,44	22,27
3 - 5 Ans	20,10	19,85
5 - 7 Ans	12,94	13,63
7 - 10 Ans	18,64	17,89
10 - 20 Ans	16,11	16,04
> 20 Ans	10,66	10,32

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](https://www.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. 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 (« OPCG », 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.

© 2025 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.

CITIGROUP est une marque déposée et de service enregistrée de Citigroup Inc. ou de ses affiliés et est utilisée et enregistrée dans le monde entier. L'indice Citi EMU Government Bond (l'« Indice ») est la propriété et la responsabilité de Citigroup Index LLC (« Citigroup »). Toutes les données de l'indice © Citigroup Index LLC 2013. Tous droits réservés. 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