

Obligations

30 avril 2023

## Catégorie d'actions

[A2] Tous les investisseurs

## Objectif du fonds

L'objectif du Fonds consiste à répliquer la performance du marché des obligations à taux fixe de sociétés durables de qualité « investment grade » libellées en euro.

## Stratégie d'investissement

La politique d'investissement du Fonds consiste à répliquer la performance de l'Indice Markit iBoxx Euro Sustainable Corporate Bond Custom (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 du marché des obligations de sociétés libellées en euro, sélectionnées sur la base de critères de durabilité. Les titres doivent avoir un taux fixe, être libellés en euro et être notés « investment grade » comme le stipule la méthodologie de l'Indice. L'inclusion est fondée sur la devise de l'émission et non sur le domicile de l'émetteur.

## Indice

Markit iBoxx Euro Sustainable Corporate Bond Custom Index

## Structure

Investment Company

## Conforme à UCITS

## Domicile

Luxembourg

## Fiche technique

ISIN	LU1266655395	
Valeur liquidative	9,92 EUR au 28 avril 2023	
Devise	EUR	
Actif net(en millions)	299,68 EUR au 28 avril 2023	
Date de lancement	23 octobre 2015	
Classification SFDR des fonds	SFDR – Article 8	
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 <sup>1</sup>		
Souscription	0.30%	
Rachat	0.00%	
Souscription initiale	EUR 300 000 000,00	
Souscriptions ultérieures	EUR 50,00	
Frais de Gestion	0,16%	
Actuel TER	0,09%	
Commission	Souscription	Rachat
Acquise au fonds	N/A	Maximum 2%

<sup>1</sup> Indicateur à la date de cette fiche informative, sujet à modification

## Performance

Annualisé	Indice	Fonds Brut	Ecart	Fonds Net	Ecart
1 An (%)	-4,51	-4,21	0,30	-4,31	0,20
3 Ans (%)	-2,81	-2,66	0,15	-2,69	0,12
5 Ans (%)	-1,22	-1,10	0,12	-1,24	-0,03
Depuis début (%)	0,02	0,11	0,09	-0,11	-0,14
<b>Cumulé</b>					
1 Mois (%)	0,67	0,67	0,00	0,66	-0,01
3 Mois (%)	0,20	0,33	0,13	0,30	0,11
1 An (%)	-4,51	-4,21	0,30	-4,31	0,20
3 Ans (%)	-8,18	-7,77	0,41	-7,84	0,34
5 Ans (%)	-5,93	-5,36	0,57	-6,05	-0,12
Depuis début (%)	0,19	0,84	0,66	-0,85	-1,03
<b>Calendrier</b>					
2023 (year to date)	2,34	2,49	0,15	2,45	0,12
2022	-13,85	-13,70	0,15	-13,79	0,05
2021	-1,11	-1,09	0,02	-1,18	-0,07
2020	2,69	2,84	0,15	2,67	-0,03
2019	6,02	6,07	0,05	5,87	-0,15

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.

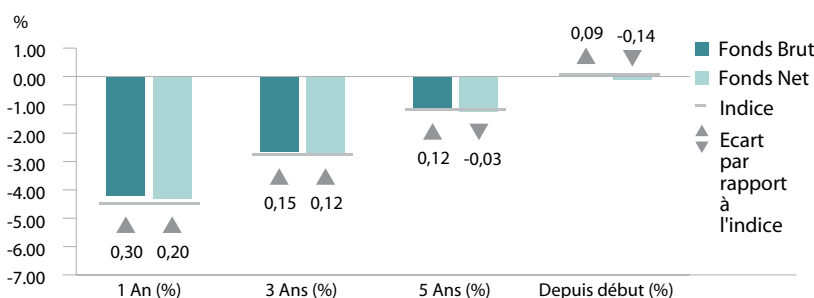
Lorsque le Fond est fermé conformément à son calendrier officiel concernant la Valeur liquidative (VL), mais avec une partie significative des prix des titres sous-jacents pouvant néanmoins être déterminée, une VL technique est calculée. La performance passée indiquée ici a donc été calculée à l'aide 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.

Avant le 1 janvier 2023, le Fonds s'appelait State Street Euro Sustainable Corporate Bond Index Fund.

Source: SSGA.

Toutes les données sont au 30/04/2023

## Performance annualisée



## Caractéristiques du fonds

	Fonds	Indice
Nombre de Lignes*	1 598	2 866
Average Yield To Worst (%)	4,05	4,06
Taux de Rendement (%)	4,10	4,10
Rendement Actuel (%)	2,10	2,02
Coupon moyen (%)	1,95	1,85
Option Adjusted Spread (Bps)	163,10	163,15
Duration effective (Ans)	4,69	4,68
Maturité moyenne (Ans)	5,24	5,19
Convexité Effective	0,33	0,33
Qualité de crédit moyenne	BAA1	BAA1

## Ratios

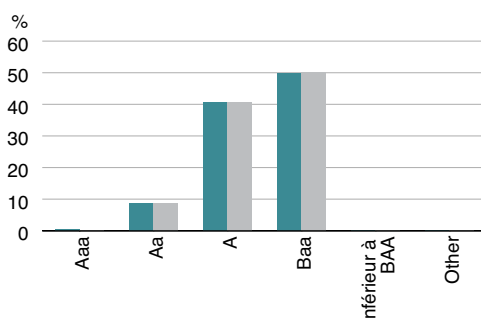
	3 Ans
Ecart type (%)	6,13
Erreur de suivi (%)	0,11
Bêta	1,01

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

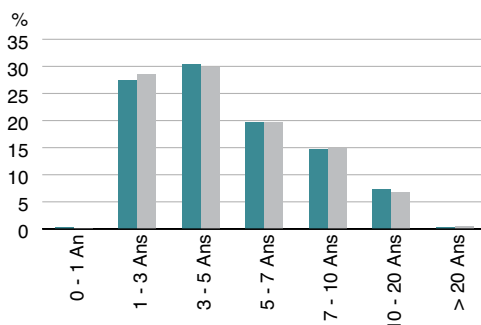
Répartition par pays	Fonds (%)	Indice (%)
France	22,00	22,16
Etats-Unis	16,41	16,99
Allemagne	10,46	10,18
Royaume-Uni	9,02	9,14
Pays-Bas	7,05	6,93
Espagne	6,96	6,86
Italie	6,64	6,94
Suède	3,12	2,95
Belgique	2,40	2,45
Suisse	1,94	1,98
Autres	14,00	13,43
<b>Total</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

Répartition qualité crédit	Fonds (%)	Indice (%)
Aaa	0,46	0,21
Aa	8,68	8,59
A	40,54	40,69
Baa	49,98	50,26
Inférieur à BAA	0,28	0,21
Other	0,07	0,02
<b>Total</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

Répartition sectorielle	Fonds (%)	Indice (%)
CORPORATE - FINANCE	44,64	45,38
CORPORATE - INDUSTRIAL	39,68	39,24
CORPORATE - UTILITY	7,58	7,43
Agence	4,26	4,45
NON CORPORATES	1,86	1,80
Autres	1,68	1,70
Monétaire	0,31	-
<b>Total</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



Répartition maturité	Fonds (%)	Indice (%)
0 - 1 An	0,31	0,05
1 - 3 Ans	27,45	28,48
3 - 5 Ans	30,31	29,89
5 - 7 Ans	19,75	19,58
7 - 10 Ans	14,63	14,82
10 - 20 Ans	7,22	6,77
> 20 Ans	0,34	0,41



**Pour plus d'informations**  
 Visitez notre site web [www.ssga.com](http://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

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.

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 [WWW.SSGA.COM](http://WWW.SSGA.COM)**

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

**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.

**Veillez 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.ssga.com](http://www.ssga.com). 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 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.**

© 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.

L'indice Markit® iBoxx® Euro Sustainable Corporate Bond Custom dont il est fait référence ici est la propriété de Markit Indices Limited et est utilisé sous licence. 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.