

# State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund

Obligations

31 mars 2025

## Catégorie d'actions

[B GBP NAV Hedged] Institutional Investors who have entered into a Qualifying Agreement

## Objectif du fonds

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

## Stratégie d'investissement

La politique d'investissement du Fonds consiste à répliquer la performance de l'indice Bloomberg Euro Aggregate Corporate Bond Index (ou tout autre indice déterminé ponctuellement par les Administrateurs pour répliquer dans une large mesure le même marché que l'indice) d'autant près que possible, en cherchant à minimiser autant que possible l'écart de suivi entre la performance du Fonds et celle de l'indice, tout en sélectionnant les titres en fonction d'une évaluation de leur respect des critères ESG, à savoir les normes internationales relatives à la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes du travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

L'indice mesure la performance du marché des obligations de sociétés libellées en euro. 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

Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index

## Structure

Investment Company

## Conforme à UCITS

## Domicile

Luxembourg

## Fiche technique

<b>ISIN</b>	LU2715965963
<b>Valeur liquidative</b>	10,62 GBP au 31 mars 2025
<b>Devise</b>	GBP
<b>Actif net(en millions)</b>	1 449,45 EUR au 31 mars 2025
<b>Date de lancement</b>	11 mars 2024
<b>Classification SFDR des fonds</b>	SFDR – Article 8
<b>Style de gestion</b>	Indiciel
<b>Zone</b>	Economic Monetary Union/Eurozone
<b>Règlement/livraison</b>	Cycle de règlement des rachats, DD+2 ; Cycle de règlement des souscriptions, DD+2
<b>Délai de notification</b>	11 h 00 (heure d'Europe centrale) le JN
<b>Valorisation</b>	Clôture journalière du marché
<b>Swing Factor<sup>1</sup></b>	
<b>Souscription</b>	0,25%
<b>Rachat</b>	0,00%
<b>Souscription initiale</b>	GBP 10 000 000,00
<b>Souscriptions ultérieures</b>	GBP 5 000,00
<b>Frais de Gestion</b>	0%
<b>Actuel TER</b>	N/A
<b>Commission</b>	<b>Souscription</b> <b>Rachat</b>
<b>Acquise au fonds</b>	N/A      Maximum 2%

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

## Performance

Annuelisé	Indice	Fonds Brut	Ecart	Fonds Net	Ecart
1 An (%)	5,76	5,95	0,18	5,91	0,15
3 Ans (%)	-	-	-	-	-
5 Ans (%)	-	-	-	-	-
Depuis début (%)	5,98	6,18	0,21	5,87	-0,10
<b>Cumulé</b>					
1 Mois (%)	-0,90	-0,89	0,01	-0,90	0,01
3 Mois (%)	0,42	0,48	0,07	0,47	0,06
1 An (%)	5,76	5,95	0,18	5,91	0,15
3 Ans (%)	-	-	-	-	-
5 Ans (%)	-	-	-	-	-
Depuis début (%)	6,31	6,53	0,22	6,20	-0,11
<b>Calendrier</b>					
2025 (year to date)	0,42	0,48	0,07	0,47	0,06
2024	5,87	6,01	0,15	5,70	-0,17

**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 fonds. Les rendements de performance enregistrés depuis le lancement seront partielles 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 Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Corporate Bond Index.

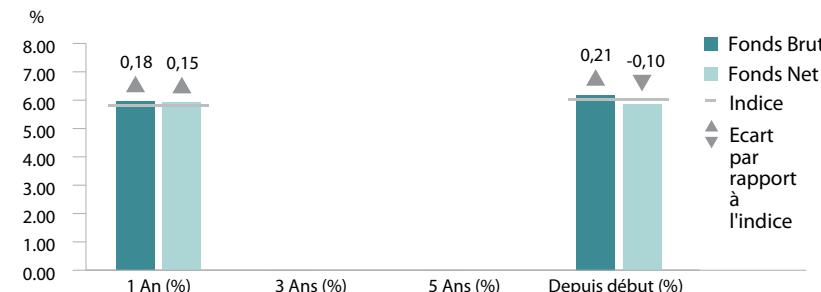
Avant le 28 mai 2021, le Fonds s'appelait State Street Euro Corporate Bond Index Fund.

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

Source: SSGA.

Toutes les données sont au 31/03/2025

## Performance annualisée



## Caractéristiques du fonds

	Fonds	Indice
Nombre de Lignes*	2 236	3 847
Average Yield To Worst (%)	3,31	3,28
Taux de Rendement (%)	3,32	3,28
Rendement Actuel (%)	3,04	2,66
Coupon moyen (%)	3,06	2,65
Option Adjusted Spread (Bps)	100,45	97,72
Duration effective (Ans)	4,47	4,45
Maturité moyenne (Ans)	5,09	5,03
Convexité Effective	0,29	0,30
Qualité de crédit moyenne	BAA1	BAA1

## Ratios

	3 Ans
Ecart type (%)	-
Erreur de suivi (%)	-
Béta	-

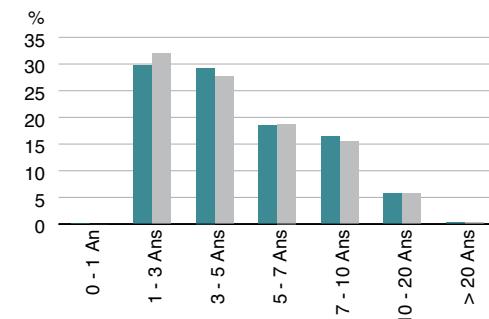
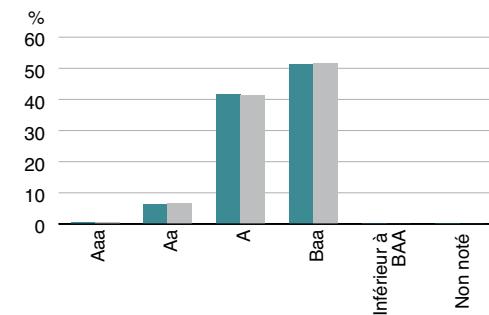
\* Le nombre d'émetteurs peut aussi inclure les positions de cash.

Répartition par pays	Fonds (%)	Indice (%)
Etats-Unis	21,36	21,39
France	19,46	19,32
Allemagne	12,65	13,50
Royaume-Uni	7,89	7,72
Espagne	6,26	6,43
Italie	5,60	5,77
Pays-Bas	5,02	4,88
Suède	3,20	3,07
Suisse	2,54	2,38
Danemark	2,04	1,94
Autres	13,97	13,60
<b>Total</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

Répartition qualité crédit	Fonds (%)	Indice (%)
Aaa	0,60	0,55
Aa	6,38	6,46
A	41,57	41,30
Baa	51,39	51,69
Inférieur à BAA	0,03	-
Non noté	0,02	0,00
<b>Total</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

Répartition maturité	Fonds (%)	Indice (%)
0 - 1 An	0,06	-
1 - 3 Ans	29,67	32,03
3 - 5 Ans	29,26	27,59
5 - 7 Ans	18,49	18,77
7 - 10 Ans	16,42	15,47
10 - 20 Ans	5,81	5,77
> 20 Ans	0,28	0,37

Répartition sectorielle	Fonds (%)	Indice (%)
CORPORATE - INDUSTRIAL	48,79	48,77
CORPORATE - FINANCE	43,20	43,06
CORPORATE - UTILITY	8,01	8,17
Monétaire	0,01	-
<b>Total</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



## 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 3000

### 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.

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.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 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.

Les marques de commerce mentionnées dans les présentes appartiennent à leurs propriétaires respectifs. Les fournisseurs de données tiers ne donnent aucune garantie ni ne formulent aucune déclaration de quelque sorte que ce soit quant à l'exactitude, l'exhaustivité ou l'actualité des données et ne sauraient être tenus responsables d'aucun préjudice de quelque nature qu'il soit relatif à l'utilisation desdites données.

La performance d'un portefeuille de titres excluant les entreprises ne répondant pas aux critères de la stratégie durable du portefeuille peut être inférieure à celle d'un portefeuille comprenant ces entreprises. En raison de ses critères de stratégie durable, un portefeuille peut être amené à investir dans des secteurs ou des titres dont les performances sont inférieures à celle du marché.

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.