

State Street Emerging Markets Tilted Local Currency Government Bond Index Fund

State Street Global
Advisors Luxembourg
SICAV

Objectif du fonds

L'objectif du Fonds consiste à répliquer la performance des obligations souveraines des marchés émergents libellées en devise locale et pouvant faire l'objet d'investissements.

Caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG)

Le fonds intègre des caractéristiques environnementales et sociales, mais son objectif n'est pas l'investissement durable. Le fonds est catégorisé « article 8 » selon le Règlement européen (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers ("SFDR")

Principales limites méthodologiques : il est possible que certaines données ESG soient incohérentes, inexactes ou inexistantes, notamment lorsqu'elles sont émises par des fournisseurs de données externes. Des détails sur ces limites sont donnés dans le Supplément.

Pour plus d'informations sur le type de caractéristiques ESG, la stratégie ESG, le processus d'investissement et le type d'approche merci de consulter le Prospectus et le Supplément du Fonds.

Stratégie d'investissement

Le Compartiment State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund (le « Compartiment ») est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice J.P. Morgan ESG-Government Bond Index Emerging Markets Global Diversified (l'« Indice »). L'Indice a été conçu aux fins de reproduire les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. L'Indice applique une méthodologie de notation et de filtrage ESG qui utilise les scores ESG des émetteurs de J.P. Morgan (« JESG ») afin de privilégier les émetteurs les mieux classés en fonction des critères ESG et des émissions d'obligations vertes, et de sous-pondérer et retirer les émetteurs moins bien classés.

Information sur le fonds

Catégorie d'actions	[B EUR] Institutional Investors who have entered into a Qualifying Agreement
Indice	JP MORGAN ESG GBI EMERGING MARKETS GLOBAL DIVERSIFIED
Structure	Investment Company
Conforme à UCITS	Oui
Domicile	Luxembourg

Fiche technique

ISIN	LU2802109434
Valeur liquidative	10,70 EUR au 31 octobre 2025
Devise	EUR
Actif net(en millions)	525,86 USD au 31 octobre 2025
Date de lancement	09 septembre 2024
Classification SFDR des fonds	SFDR – Article 8
Style de gestion	Indiciel
Zone	Monde
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) à JN-1
Valorisation	Clôture journalière du marché
Swing Factor ¹	
Souscription	0.08%
Rachat	0.08%
Souscription initiale	EUR 10 000 000,00
Souscriptions ultérieures	EUR 5 000,00
Frais de Gestion	0%
Actuel TER	0,08%
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	7,23	7,00	-0,23	7,01	-0,22
3 Ans	-	-	-	-	-
5 Ans	-	-	-	-	-
Depuis début	6,22	6,03	-0,20	6,13	-0,09
Cumulé (%)					
1 Mois	2,14	2,10	-0,03	2,10	-0,04
3 Mois	3,45	3,40	-0,05	3,38	-0,07
1 An	7,23	7,00	-0,23	7,01	-0,22
3 Ans	-	-	-	-	-
5 Ans	-	-	-	-	-
Depuis début	7,14	6,91	-0,23	7,03	-0,10
Calendrier (%)					
2025 (YTD)	5,12	4,94	-0,17	4,96	-0,16
2024 (partiel)	1,92	1,87	-0,05	1,98	0,05

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.

Avant le 30 April 2025, le Fonds s'appelait State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund.

Source: State Street Investment Management.

Toutes les données sont au 31/10/2025

Caractéristiques

	Fonds	Indice
Nombre de Lignes*	496	432
Average Yield To Worst (%)	6,24	6,25
Taux de Rendement (%)	6,24	6,25
Rendement Actuel (%)	5,90	5,88
Coupon moyen (%)	5,58	5,53
Option Adjusted Spread (Bps)	-3,09	-4,17
Duration effective (Ans)	5,31	5,32
Maturité moyenne (Ans)	7,49	7,48
Convexité Effective	0,53	0,53
Qualité de crédit moyenne	BAA2	BAA2

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

Ratios	3 Ans
Ecart type (%)	-
Erreur de suivi (%)	-
Bêta	-

Répartition par pays

	Fonds (%)	Indice (%)
Malaisie	10,02	10,00
Pologne	9,98	10,00
Mexique	9,95	10,00
Thaïlande	8,85	8,87
Afrique du Sud	7,99	7,98
Brésil	7,70	7,75
Indonésie	7,16	7,15
Chine	7,13	7,12
Inde	7,07	7,14
République Tchèque	6,65	6,68
Autres	17,51	17,32
Total	100,00	100,00

Répartition sectorielle

	Fonds (%)	Indice (%)
Dette Souveraine	98,77	100,00
Monétaire	0,72	-
NON CORPORATES	0,43	-
Agence	0,08	-
Total	100,00	100,00

Répartition qualité crédit

	Fonds (%)	Indice (%)
Aaa	0,72	-
Aa	6,61	6,68
A	28,40	28,19
Baa	42,33	42,96
Inférieur à BAA	21,94	22,17
Total	100,00	100,00

Répartition maturité

	Fonds (%)	Indice (%)
0 - 1 An	5,81	5,06
1 - 3 Ans	18,09	18,30
3 - 5 Ans	21,63	22,20
5 - 7 Ans	13,58	13,63
7 - 10 Ans	18,39	18,70
10 - 20 Ans	16,12	15,80
> 20 Ans	6,38	6,31

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.

Veillez 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.

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.

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.

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 : 20/12/2025