

Catégorie d'actions

[I] Institutionnels

Objectif du fonds

L'objectif du Fonds consiste à répliquer, dans les limites du raisonnable, la performance de l'indice Citigroup EMU Government Bond Index (EGBI)SM 15 years + (l'« Indice »).

Stratégie d'investissement

Le Fonds investit principalement dans des titres compris dans l'Indice. Le Fonds s'efforce de détenir tous les titres qui composent l'Indice avec des pondérations approximativement équivalentes à celles de l'Indice. Dans des circonstances bien déterminées, le Fonds peut acheter des titres non compris dans l'Indice.

Indice

FTSE EMU Government Bond 15 Years + Index

Structure

Compartiment de la SICAV SSGA Index Funds

Conforme à UCITS

Domicile

Luxembourg

Fiche technique

ISIN	LU0956453301	
Valeur liquidative	14,19 EUR au 31 July 2018	
Devise	EUR	
Actif net (en millions)	109,56 EUR au 31 July 2018	
Date de début	24 January 2014	
Style de gestion	Bêta	
Zone	Europe	
Règlement/livraison	DD+2	
Délai de notification	DD 11:00AM CET time	
Valorisation	Daily market close	
Swing Factor ¹		
Souscription	0.06%	
Rachat	0.00%	
Souscription initiale	EUR 3 000 000	
Souscriptions ultérieures	EUR 1 000	
Frais de Gestion	0,15%	
Actuel TER	0,25%	
Commission	Souscription	Rachat
Acquise au fonds	N/A	N/A
Non acquise au fonds	3,00%	2,00%

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

Performance

Annualisé	Indice	Fonds Brut	Ecart	Fonds Net	Ecart
1 An (%)	4,32	4,32	-0,01	4,06	-0,26
3 Ans (%)	2,94	2,93	0,00	2,69	-0,25
5 Ans (%)	8,33	8,32	-0,01	8,06	-0,27
Depuis début (%)	7,28	7,22	-0,06	6,98	-0,30
Cumulé					
1 Mois (%)	-0,73	-0,73	0,00	-0,75	-0,02
3 Mois (%)	-1,05	-1,05	0,00	-1,11	-0,07
1 An (%)	4,32	4,32	-0,01	4,06	-0,26
3 Ans (%)	9,07	9,06	-0,01	8,28	-0,80
5 Ans (%)	49,19	49,14	-0,05	47,36	-1,83
Depuis début (%)	115,27	114,07	-1,20	108,80	-6,47
Calendrier					
2018 (year to date)	2,18	2,18	-0,01	2,03	-0,15
2017	-0,77	-0,77	0,00	-1,02	-0,25
2016	7,92	7,92	0,01	7,67	-0,24
2015	2,24	2,23	0,00	1,98	-0,26
2014	32,25	32,24	-0,01	31,93	-0,32

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.

Les performances passées rapportées avant la date de lancement du Fonds le sont à titre indicatif uniquement. Les performances passées rapportées avant la date de lancement du Fonds ont été adaptées et liées aux performances du fonds absorbé au 24 janvier 2014, qui a une politique d'investissement et un profil de risque comparables. La date de lancement de la performance est le 31 août 2007.

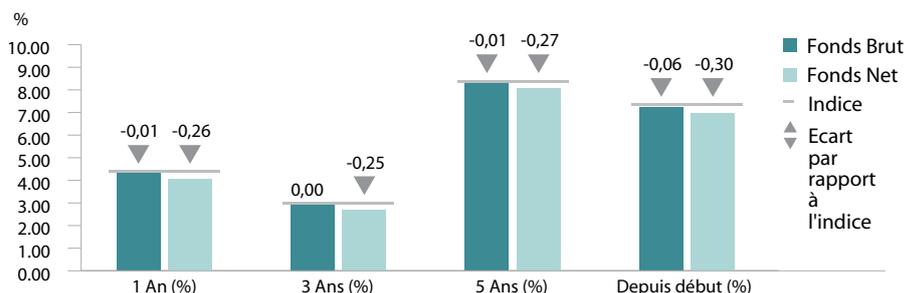
S'il vous plaît noter les chiffres de performance avant Avril 2013 ont été calculés en utilisant le prix unswung. La méthode de calcul des rendements en valeur ajoutée peut faire apparaître des écarts d'arrondis.

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 31/07/2018

Performance annualisée



Caractéristiques du fonds

	Fonds	Indice
Coupon moyen (%)	3,68	3,66
Maturité moyenne (Ans)	24,02	24,04
Average Yield To Worst (%)	1,74	1,75
Rendement Actuel (%)	2,68	2,68
Convexité Effective	4,15	4,15
Duration effective (Ans)	17,62	17,63
Taux de Rendement (%)	1,74	1,75
Option Adjusted Spread (Bps)	84,36	84,71
Nombre de Lignes	62	61

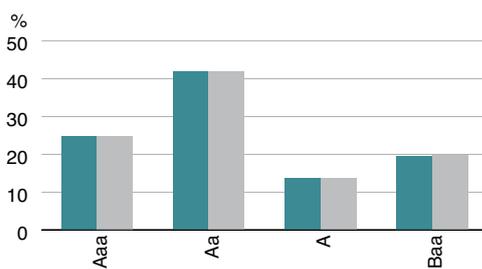
Ratios

	3 Ans
Ecart type (%)	9,31
Erreur de suivi (%)	0,02
Bêta	1,00

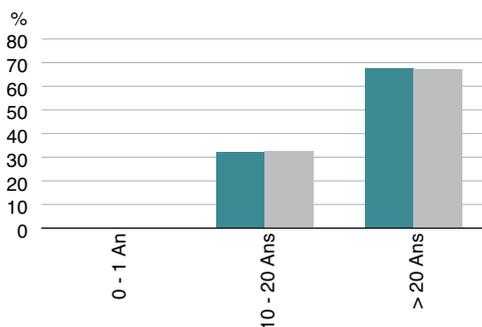
Répartition par pays	Fonds (%)	Indice (%)
France	26,10	26,10
Italie	19,62	19,76
Allemagne	19,01	19,02
Espagne	12,37	12,36
Belgique	9,75	9,73
Pays-Bas	5,78	5,77
Autriche	5,10	5,12
Irlande	1,25	1,27
Finlande	0,86	0,87
Union européenne	0,16	-
Total	100,00	100,00

Répartition qualité crédit	Fonds (%)	Indice (%)
Aaa	24,94	24,79
Aa	41,82	41,82
A	13,62	13,63
Baa	19,62	19,76
Total	100,00	100,00

Répartition sectorielle	Fonds (%)	Indice (%)
Dettes Souveraines	99,84	100,00
Monétaire	0,16	-
Total	100,00	100,00



Répartition maturité	Fonds (%)	Indice (%)
0 - 1 An	0,16	-
10 - 20 Ans	32,19	32,53
> 20 Ans	67,65	67,47



Les caractéristiques, positions, allocations par pays et secteurs représentés le sont à la date indiquée 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

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.

© 2018 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 Index (EGBI) 15 Years+ (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.

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.

Pour plus d'Information

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 6130

SSGA Middle East & North Africa

+971 (0) 4 437 2800

SSGA Netherlands

+31 (0) 20 718 1701

SSGA Switzerland

+41 (0) 44 245 7099

SSGA United Kingdom

+44 (0) 20 3395 2333