State Street Global Aggregate Bond Index Fund

Catégorie d'actions

[I EUR Portfolio Hedged] Investisseurs institutionnels

Objectif du fonds

L'objectif du Fonds consiste à répliquer la performance du marché obligataire mondial.

Stratégie d'investissement

La politique d'investissement du Fonds consiste à répliquer la performance de l'indice Bloomberg Global Aggregate Bond Index (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 obligataire mondial. l'indice comprend des obligations de sociétés, d'État et liées à des gouvernements, ainsi que des titres adossés à des actifs, adossés à des créances hypothécaires et adossés à des créances hypothécaires commerciales, d'émetteurs issus aussi bien des marchés émergents que développés. Les titres doivent avoir un taux fixe et être notés « investment grade » comme le stipule la méthodologie de l'indice.

En ce qui concerne les obligations de sociétés, le Gestionnaire d'investissement utilise un filtre ESG négatif et basé sur des normes avant la construction du portefeuille du Fonds et de manière continue.

Indice

Bloomberg Global Aggregate Bond Index (EUR hedged)

Structure

Investment Company

Conforme à UCITS

Domicile

Luxembourg

Fiche technique

ISIN	LU0956450547	
Valeur liquidative	10,46 EUR au 29 avril 2022	
Devise	EUR	
Actif net(en millions)	5 191,38 USD au 29 avril 2022	
Date de lancement	10 avril 2014	
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	14 h 00 (heure d'Europe centrale) à JN-1	
Valorisation	Clôture journalière du marché	
Swing Factor[1]		
Souscription	0.09%	
Rachat	0.01%	
Souscription initiale	EUR 3 000 000,00	
Souscriptions ultérieures	EUR 1 000,00	
Frais de Gestion	0,18%	
Actuel TER	0,23%	
Commission	**Souscription**	**Rachat**
Acquise au fonds	N/A	Maximum 2%

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

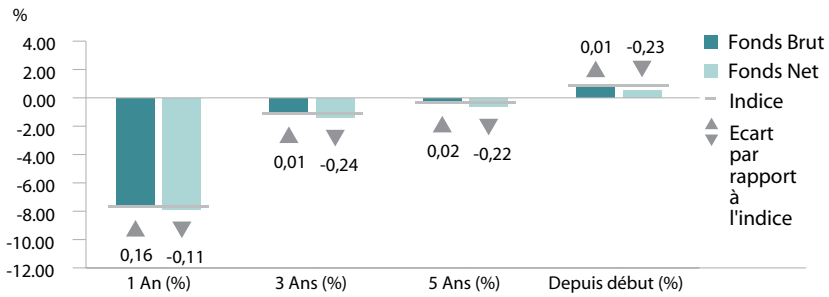
Performance

Annualisé	**Indice**	**Fonds Brut**	**Ecart**	**Fonds Net**	**Ecart**
1 An (%)	-7,77	-7,61	0,16	-7,88	-0,11
3 Ans (%)	-1,17	-1,16	0,01	-1,41	-0,24
5 Ans (%)	-0,42	-0,40	0,02	-0,63	-0,22
Depuis début (%)	0,79	0,80	0,01	0,56	-0,23
Cumulé					
1 Mois (%)	-2,93	-2,94	-0,01	-3,05	-0,12
3 Mois (%)	-6,48	-6,37	0,11	-6,42	0,06
1 An (%)	-7,77	-7,61	0,16	-7,88	-0,11
3 Ans (%)	-3,46	-3,43	0,03	-4,17	-0,71
5 Ans (%)	-2,06	-1,98	0,08	-3,12	-1,06
Depuis début (%)	6,54	6,64	0,10	4,58	-1,96
Calendrier					
2022 (year to date)	-8,03	-7,88	0,16	-7,95	0,09
2021	-2,23	-2,19	0,04	-2,41	-0,18
2020	4,24	4,09	-0,15	3,85	-0,39
2019	5,10	5,12	0,02	4,87	-0,23
2018	-1,04	-0,98	0,07	-1,21	-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 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 décembre 2021, l'indice du fonds était leBloomberg Barclays Global Aggregate Bond Index.

Source: SSGA.
Toutes les données sont au 30/04/2022

Perfomance annualisée



Caractéristiques du fonds	**Fonds**	**Indice**
Nombre de Lignes*	8 595	28 132
Average Yield To Worst (%)	2,52	2,57
Taux de Rendement (%)	2,52	2,57
Rendement Actuel (%)	2,06	2,26
Coupon moyen (%)	2,03	2,28
Option Adjusted Spread (Bps)	44,84	48,03
Duration effective (Ans)	7,12	7,13
Maturité moyenne (Ans)	8,81	8,92
Convexité Effective	0,95	0,95
Qualité de crédit moyenne	AA3	AA3

Ratios	**3 Ans**
Ecart type (%)	3,84
Erreur de suivi (%)	0,14
Bêta	1,00

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

Répartition par pays

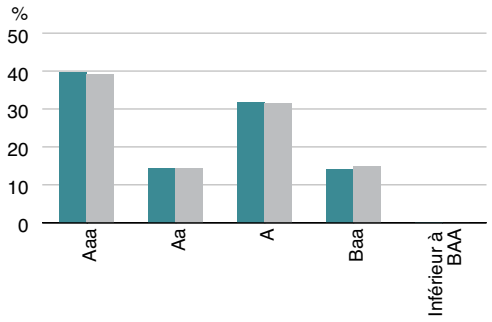
	Fonds (%)	Indice (%)
Etats-Unis	39,33	39,10
Japon	12,92	12,80
Chine	8,56	8,86
France	5,12	5,15
Royaume-Uni	4,83	4,86
Allemagne	4,63	4,66
Canada	3,94	3,60
Italie	3,04	3,08
Espagne	2,21	2,23
Supranational	2,16	2,20
Autres	13,26	13,46
Total	**100,00**	**100,00**

Répartition sectorielle

	Fonds (%)	Indice (%)
Dette Souveraine	54,54	52,76
Titre adossé à des créances hypothécaires	12,30	12,64
CORPORATE - INDUSTRIAL	9,60	9,65
CORPORATE - FINANCE	6,90	7,06
Agence	6,37	6,77
NON CORPORATES	5,61	5,76
Autres	2,64	2,92
CORPORATE - UTILITY	1,45	1,48
CMBS	0,54	0,80
Titre adossé à des actifs	0,03	0,17
Monétaire	0,02	-
Total	**100,00**	**100,00**

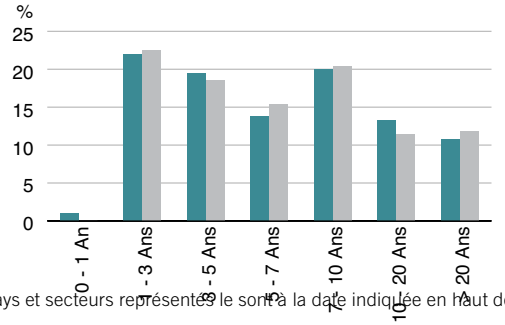
Répartition qualité crédit

	Fonds (%)	Indice (%)
Aaa	39,79	39,25
Aa	14,34	14,34
A	31,76	31,56
Baa	14,09	14,86
Inférieur à BAA	0,02	-
Total	**100,00**	**100,00**



Répartition maturité

	Fonds (%)	Indice (%)
0 - 1 An	0,94	-
1 - 3 Ans	21,91	22,45
3 - 5 Ans	19,39	18,56
5 - 7 Ans	13,79	15,32
7 - 10 Ans	19,94	20,41
10 - 20 Ans	13,22	11,40
> 20 Ans	10,81	11,86



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

Pour plus d'informations

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 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

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.
Les compartiments ne sont pas disponibles pour les investisseurs américains. **Veuillez consulter la dernière mise à jour du Document d'information clé pour l'investisseur (DICI), ainsi que le Prospectus du Fond avant toute décision d'investissement. La version anglaise la plus récente du Prospectus et du DICI sont consultables à l'adresse 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.
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.
© 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.
« Bloomberg® » et tous les indices Bloomberg sont des marques de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses filiales, y compris Bloomberg Index Services Limited (« BISL »), l'administrateur de l'indice (collectivement, « Bloomberg ») et ont fait l'objet d'une licence d'utilisation à certaines fins par State Street Bank and Trust Company, par le biais de sa division State Street Global Advisors (« SSGA »). Bloomberg n'est pas affiliée à SSGA, et Bloomberg n'approuve, ne promeut, n'évalue ni ne recommande aucun produit SSGA. Bloomberg ne garantit aucunement le caractère opportun, ni l'exactitude ou l'exhaustivité des données ou informations, quelles qu'elles soient, relatives à un produit SSGA, quel qu'il soit.
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.

If your account holds Russian securities and instruments, then as of the date of this publication, they have been fair valued. Such fair value may be zero. If your portfolio holds such Russian securities and instruments, then the portfolio may not be able to dispose of such securities and instruments depending on the relevant market, applicable sanctions requirements, and/or Russian capital controls or other counter measures. In such circumstances, the portfolio would continue to own and have exposure to Russian-related issuers and markets. Please refer to your portfolio holdings report.

© 2022 STATE STREET CORPORATION. TOUS DROITS RÉSERVÉS.